



PIMCO

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

Rapport semestriel

30 juin 2023



CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES

Type de Fonds :

OPCVM

Nombre de Fonds proposés par la Société :

56 Fonds

Catégories d'Actions proposées par la Société au 30 juin 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 PLN (couverte)
 Institutions en RMB (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 JPY (couverte)
 Investisseurs en NOK (couverte)
 Investisseurs en RMB (couverte)
 Investisseurs en SEK (couverte)
 Investisseurs en SGD (couverte)
 Investisseurs en USD (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 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 NOK (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)

G Détail en EUR (non couverte)

H Institutions

H Institutions en EUR (couverte)

H Institutions en USD (exposition au risque de change)

H Institutions en USD (couverte)

M Détail

M Détail en AUD (couverte)

M Détail en HKD (non couverte)

M Détail en SEK (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 CAD (couverte)

Catégorie W en CHF (couverte)

Catégorie W en EUR (couverte)

Catégorie W en GBP (couverte)

Catégorie W en NOK (couverte)

Catégorie W en SEK (couverte)

Catégorie W en SGD (couverte)

Catégorie W en USD (exposition au risque de change)

Catégorie Z

Catégorie Z en AUD (couverte)

Catégorie Z en EUR (couverte)

Catégorie Z en GBP (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) et des Actions de distribution II (Actions cherchant à fournir un rendement amélioré).

Actif net (en milliers) :

158 304 274 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. Les Catégories Z supposent une participation minimale de 20 millions d'USD ou l'équivalent dans la

CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES (suite)

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 de fonctionnement des Fonds :

USD (\$), sauf pour les Fonds UK Corporate Bond Fund et UK Long Term Corporate Bond Fund, libellés en livres sterling britanniques (£), 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 euros (€).

CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES (suite)

Autorisation à Hong Kong :

La Société et certains de ses Fonds sont autorisés par la Commission des opérations sur titres 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 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 PIMCO Global Core Asset Allocation 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 :
 PAFPLC

	Page
Informations sur le marché*	4
Informations importantes concernant les Fonds	5
Description des indices de référence	68
Bilan	74
Compte de Résultat	94
État de l'évolution des actifs nets	114
Tableau des investissements	120
Notes relatives aux États financiers	738
Variations importantes de la composition du portefeuille	798
Glossaire	856
Informations générales	858

FONDS	Synthèse des Fonds*	Tableau des investissements
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	7	120
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	8	129
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	9	137
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	11	145
Fonds Commodity Real Return Fund	12	153
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	13	163
Fonds Diversified Income Fund	14	172
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	16	189
Fonds Diversified Income ESG Fund	17	199
Fonds Dynamic Bond Fund	18	206
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	19	223
Fonds Emerging Local Bond Fund	20	234
Fonds Emerging Local Bond ESG Fund	21	250
Fonds Emerging Markets Bond Fund	22	258
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	23	274
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	24	288
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	25	296
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	26	310
Fonds PIMCO ESG Income Fund	27	321
Fonds Euro Bond Fund	28	333
Fonds Euro Credit Fund	29	341
Fonds Euro Income Bond Fund	30	347
Fonds Euro Long Average Duration Fund	31	356
Fonds Euro Short-Term Fund	32	362
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	33	367
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	34	373
Fonds Global Advantage Fund	35	379
Fonds Global Bond Fund	36	397
Fonds Global Bond ESG Fund	38	422
Fonds Global Bond Ex-US Fund	39	439
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	40	455
Fonds Global High Yield Bond Fund	41	468
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	42	478
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	44	499
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	45	513
Fonds Global Real Return Fund	46	521
Fonds Income Fund	47	531
Fonds Income Fund II	49	569
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	50	576
Fonds Low Average Duration Fund	51	585
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	52	593
Fonds Low Duration Income Fund	53	602

FONDS	Synthèse des Fonds*	Tableau des investissements
Fonds Low Duration Opportunities Fund	54	616
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	55	627
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	56	630
Fonds Mortgage Opportunities Fund	57	633
Fonds StocksPLUS™ Fund	58	642
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	59	649
Fonds Strategic Income Fund	60	654
Fonds Total Return Bond Fund	61	671
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	62	684
Fonds UK Corporate Bond Fund	63	700
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	64	707
Fonds US High Yield Bond Fund	65	713
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	66	721
Fonds US Short-Term Fund	67	731

Le présent Rapport semestriel peut être traduit dans d'autres langues que l'anglais. Chacune de ces traductions contient les mêmes informations et a le même sens que le Rapport semestriel en anglais. En cas de contradiction entre le Rapport semestriel en anglais et le Rapport semestriel dans une autre langue, le Rapport semestriel 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 fondée sur des informations contenues dans un Rapport semestriel dans une langue autre que l'anglais, la langue du Rapport semestriel sur laquelle une telle action est basée prévaudra. Tout litige concernant les termes du Rapport semestriel, quelle que soit la langue du Rapport semestriel, sera régi par et interprété conformément au droit irlandais.

* 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 commerciale d'Allianz Asset Management of America LLC aux États-Unis et dans le monde entier. ©2023, PIMCO.

Informations sur le marché

Cher Actionnaire,

Le présent rapport semestriel couvre la période comptable de six mois close le 30 juin 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 impact sur la performance au cours de la période comptable.

Dans un contexte d'inflation élevée dans de nombreux pays au cours de la période considérée, l'économie mondiale a été confrontée aux défis liés à la hausse des taux d'intérêt, au resserrement des conditions de crédit résultant des turbulences au sein du secteur bancaire (en particulier aux États-Unis), ainsi qu'à des préoccupations géopolitiques. Si l'économie américaine a montré des signes de résilience, certaines économies européennes ont vu leur croissance ralentir pendant la période considérée.

Poursuite des efforts des banques centrales visant à endiguer l'inflation

Alors que l'inflation est restée élevée au cours de la période considérée, de nombreuses banques centrales ont relevé les taux d'intérêt pour enrayer la hausse des prix. La Réserve fédérale américaine (la « Fed ») a relevé le taux des fonds fédéraux lors de dix réunions consécutives, entre mars 2022 et mai 2023. En juin 2023, la Fed a marqué une pause dans le relèvement des taux afin d'« évaluer les informations supplémentaires et leurs implications pour la politique monétaire ». Dans le même temps, la Banque d'Angleterre et la Banque centrale européenne relevaient leurs taux d'intérêt pour la treizième et la huitième fois consécutives, respectivement, en juin 2023. En revanche, la Banque du Japon a maintenu l'orientation accommodante de sa politique monétaire.

Des rendements en demi-teinte sur les marchés financiers

Le rendement du bon du Trésor américain à 10 ans, titre de référence, a baissé au cours de la période considérée, tandis que les rendements des obligations à 10 ans augmentaient dans la plupart des autres pays développés. Le marché mondial des obligations de crédit a généré des rendements totaux positifs. Les obligations mondiales les mieux notées ont enregistré une performance inférieure à celle des obligations moins bien notées. Les actions mondiales ont rebondi, tandis que les prix des matières premières étaient volatils et généraient des rendements mitigés. Le dollar américain s'est affaibli par rapport à l'euro et à la livre sterling, mais s'est apprécié par rapport au yen japonais.

Dans un contexte de conditions évolutives, nous continuons à travailler avec diligence pour tirer le meilleur parti des turbulences des marchés 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

Rendements totaux de certaines catégories d'actifs pour la période close le 30 juin 2023	
Catégorie d'actifs (mesurée par l'indice, devise)	Six mois
Actions des grandes capitalisations américaines (Indice S&P 500 Index, USD)	16,89 %
Actions mondiales (Indice MSCI World Index, USD)	15,09 %
Actions européennes (Indice MSCI Europe Index, EUR)	11,12 %
Actions des marchés émergents (Indice MSCI Emerging Markets Index, EUR)	4,89 %
Actions japonaises (Indice Nikkei 225 Index, JPY)	28,65 %
Obligations locales des marchés émergents (Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, non couvert en USD)	7,79 %
Dettes extérieures des marchés émergents (Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, couvert en USD)	3,81 %
Obligations de qualité inférieure à « investment grade » (Indice ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index, couvert en USD)	5,45 %
Obligations mondiales de qualité « investment grade » (Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index, couvert en USD)	3,00 %
Dettes publiques en devise locale à taux fixe de pays de qualité « investment grade » (Indice Bloomberg Global Treasury Index, couvert en USD)	3,13 %

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.

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.

Informations importantes concernant 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 informations, ainsi que d'autres, sont précisées 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'amoinrir 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 (espérance de vie estimée d'un titre) 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 divers risques, outre ceux décrits ci-dessus, dans le Prospectus des Fonds et dans les Risques financiers figurant aux 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 réglementations relatives à l'information financière. La classification des participations d'un portefeuille particulier comme indiquée dans les sections Tableau des investissements du présent 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 pour le recours à l'argent à court terme. Compte tenu de la disparition progressive de l'utilisation du LIBOR, les Fonds concernés devront effectuer une transition vers un autre indice de référence (par exemple, le taux de financement au jour le jour garanti (SOFR), qui remplace le LIBOR en dollar américain, mesure le coût des emprunts au jour le jour sur le marché des contrats 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 semestriel, 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.

Informations importantes concernant les Fonds (suite)

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 semestriel revêtent la signification qui leur est donnée dans le Prospectus de la Société.

Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 14 février 2019)	(0,79 %)	(2,81 %)
Institutions, distribution (lancement le 14 février 2019)	(0,79 %)	(2,79 %)
Investisseurs, capitalisation (lancement le 25 mai 2021)	(0,93 %)	(13,20 %)
Investisseurs, distribution (lancement le 20 août 2020)	(0,91 %)	(7,98 %)
Administrations, distribution (lancement le 14 février 2019)	(1,03 %)	(3,27 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 1 ^{er} juillet 2020)	(1,22 %)	(6,90 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 14 février 2019)	(1,23 %)	(3,66 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 12 mars 2021)	(0,91 %)	(11,14 %)
H Institutions, distribution (lancement le 12 mars 2021)	(1,01 %)	(11,15 %)
M Détail, distribution II (lancement le 14 février 2019)	(1,09 %)	(3,64 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 14 février 2019)	(0,44 %)	(2,16 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	1,99 %	(3,02 %) ²
Catégories libellées en AUD		
Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021)	(2,14 %)	(12,77 %)
Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2020)	(2,20 %)	(8,77 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en AUD)	0,76 %	(9,00 %) ²
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 23 octobre 2020)	(2,96 %)	(9,94 %)
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 23 octobre 2020)	(2,98 %)	(9,94 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 23 octobre 2020)	(3,41 %)	(10,74 %)
Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 23 octobre 2020)	(3,41 %)	(10,74 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en CHF)	(0,18 %)	(10,23 %)
Catégories libellées en CNH		
Investisseurs en RMB (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020)	(2,49 %)	(7,64 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en CNH)	0,38 %	(7,61 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 septembre 2020)	(2,04 %)	(9,16 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 septembre 2020)	(2,06 %)	(9,13 %)
Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 10 septembre 2020)	(2,35 %)	(9,93 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 septembre 2020)	(2,47 %)	(9,94 %)
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 septembre 2020)	(2,64 %)	(9,98 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en EUR)	0,61 %	(10,06 %) ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 29 juillet 2021)	(1,28 %)	(12,55 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 6 mai 2021)	(1,36 %)	(12,88 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en GBP)	1,37 %	(13,11 %) ²
Catégories libellées en HKD		
Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 14 février 2019)	(0,81 %)	(3,66 %)
M Détail en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 14 février 2019)	(0,96 %)	(3,71 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (non couvert en HKD)	2,40 %	(3,05 %)
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021)	(1,41 %)	(12,13 %)
Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 20 août 2020)	(1,65 %)	(8,21 %)
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 14 février 2019)	(1,86 %)	(4,02 %)
M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 14 février 2019)	(1,92 %)	(4,02 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en SGD)	1,27 %	(3,57 %) ²

Le Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund vise à optimiser sa performance totale 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 :

- » 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 sous-pondération du positionnement sur la duration américaine a contribué à la performance relative, les taux ayant augmenté au cours de la période.
- » Il n'y a pas eu d'autres contributeurs importants.
- » La sélection de crédit dans le secteur immobilier chinois a nuï à la performance relative.
- » La sous-pondération du crédit souverain des marchés émergents en Asie a nuï à la performance relative, notamment en raison d'une sous-pondération du crédit souverain du Sri Lanka.
- » La sous-pondération du crédit quasi-souverain des marchés émergents en Asie a nuï 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.

Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 2 mai 2023)	—	(0,50 %)
Institutions, distribution (lancement le 4 septembre 2020)	1,34 %	(4,02 %)
Investisseurs, capitalisation (lancement le 2 mai 2023)	—	(0,50 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 4 septembre 2020)	0,81 %	(4,86 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 1 ^{er} juin 2010)	0,97 %	2,28 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 1 ^{er} décembre 2020)	1,59 %	(4,25 %)
Indice JPMorgan Asia Credit ²	2,92 %	3,10 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mai 2023)	—	(0,90 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 5 mars 2021)	0,13 %	(7,13 %)
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mai 2023)	—	(1,00 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 mars 2021)	(0,36 %)	(7,91 %)
Indice JPMorgan Asia Credit (couvert en EUR) ³	1,65 %	(6,14 %) ²
Catégories libellées en EUR (non couvertes)		
Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 3 juin 2011)	(1,34 %)	2,81 %
Indice JPMorgan Asia Credit (non couvert en EUR) ³	0,68 %	4,13 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 13 août 2021)	0,70 %	(7,82 %)
Indice JPMorgan Asia Credit (couvert en GBP) ³	2,38 %	(6,55 %)
Catégories libellées en HKD		
Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 4 septembre 2020)	1,26 %	(4,47 %)
M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} mars 2011)	1,25 %	0,91 %
Indice JPMorgan Asia Credit (non couvert en HKD) ³	3,41 %	2,03 % ²
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020)	0,61 %	(4,12 %)
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020)	0,26 %	(4,91 %)
Indice JPMorgan Asia Credit (couvert en SGD) ³	2,29 %	(3,82 %)

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 % Libor USD à un mois] * [Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)]/[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 rendement élevé (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 :

- » L'exposition au crédit d'entreprises asiatiques hors Chine/Hong Kong a contribué à la performance absolue.
- » L'exposition à la dette souveraine du Pakistan et du Sri Lanka a contribué à la performance absolue.
- » L'exposition aux obligations quasi souveraines asiatiques a contribué à la performance absolue.
- » L'exposition au crédit d'entreprises de Chine et de Hong Kong a nui à la performance absolue, notamment en raison d'une exposition au secteur immobilier chinois.
- » L'exposition à la duration américaine a nui à la performance absolue, les taux ayant augmenté au cours de la période.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 juillet 2013)	(1,18 %)	4,35 %
Institutions, distribution (lancement le 23 septembre 2014)	(1,16 %)	3,42 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 19 mai 2014)	(1,35 %)	3,02 %
Investisseurs, distribution (lancement le 19 mai 2014)	(1,36 %)	3,03 %
Administrations, capitalisation (lancement le 9 août 2013)	(1,40 %)	3,76 %
Administrations, distribution (lancement le 9 août 2013)	(1,45 %)	3,75 %
Administrations, distribution II (lancement le 12 août 2022)	(1,40 %)	(3,34 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 octobre 2013)	(1,61 %)	3,11 %
Catégorie E, distribution (lancement le 19 mai 2014)	(1,62 %)	2,48 %
M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	(1,63 %)	2,88 %
Catégorie R, distribution (lancement le 18 mars 2014)	(1,31 %)	3,37 %
Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)	(1,82 %)	2,39 %
Catégorie Z, distribution (lancement le 31 octobre 2013)	(0,80 %)	4,82 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ²	2,40 %	1,26 % ²
Catégories libellées en AUD		
Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)	(2,11 %)	0,64 %
Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 11 août 2015)	(1,55 %)	3,60 %
Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,70 %	1,45 % ²
Catégories libellées en BRL		
Institutions en BRL (couverte), capitalisation (lancement le 2 janvier 2018)	11,84 %	(1,39 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en BRL) ³	15,87 %	(0,85 %)
Catégories libellées en CAD		
Investisseurs en CAD (couverte), distribution (lancement le 25 juin 2018)	(1,57 %)	1,40 %
Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA) ⁴	2,25 %	1,51 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)	(3,18 %)	2,14 %
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 juin 2014)	(3,56 %)	0,03 %
Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁵	0,61 %	(0,69 %) ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)	(2,28 %)	2,60 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 9 août 2013)	(2,27 %)	2,61 %
Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 29 juillet 2014)	(2,24 %)	1,51 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 26 février 2016)	(2,37 %)	1,96 %
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)	(2,51 %)	2,08 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 octobre 2013)	(2,72 %)	1,42 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)	(2,68 %)	0,35 %
Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 18 juin 2014)	(2,31 %)	1,27 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	(2,91 %)	0,39 %
Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁶	1,34 %	(0,06 %) ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)	(1,49 %)	3,38 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 juillet 2013)	(1,44 %)	3,45 %
Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2020)	(1,64 %)	(2,46 %)
Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 18 juin 2014)	(1,59 %)	2,06 %
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁷	2,06 %	0,77 % ²
Catégories libellées en HKD		
M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017)	(1,19 %)	1,28 %
Indice HIBOR Index à 3 mois	2,20 %	1,63 %

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 attrayant 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, 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 :

- » L'exposition aux titres financiers senior et la sélection des titres au sein de ce secteur ont contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La sélection des titres au sein des obligations de niveau 2 (Tier 2) a contribué à la performance, car une banque britannique a annoncé qu'elle rachèterait ses obligations de type Legacy Tier 2 à la prochaine date d'achat.
- » L'exposition aux obligations supplémentaires de niveau 1 (Additional Tier 1, AT1) émises par une banque suisse a nuí à la performance, ces titres ayant été dépréciés suite à l'acquisition par un concurrent local.
- » L'exposition aux AT1, et en particulier aux banques britanniques, a nuí à la performance, le marché bancaire mondial ayant subi des pressions sous l'effet de la crise de confiance liée à certaines petites banques régionales américaines, qui a atteint l'Europe.
- » L'exposition à un émetteur de titres hybrides subordonnés du secteur non financier a nuí à la performance.

Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹ (suite)

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021)	(1,69 %)	(6,89 %)
Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)	(1,89 %)	1,22 %
Administrations en SGD (couverte), distribution II (lancement le 12 août 2022)	(1,92 %)	(3,98 %)
M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	(2,06 %)	2,66 %
Taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour SORA ²	1,82 %	1,22 % 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 net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)	2,27 %	(3,66 %)
Investisseurs, capitalisation (lancement le 28 février 2023)	—	1,10 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)	2,46 %	(3,16 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en USD)	3,28 %	(5,71 %) ²
Catégories libellées en AUD		
Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 17 avril 2023)	—	(0,52 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en AUD)	2,35 %	0,59 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 13 novembre 2020)	0,12 %	(6,29 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en CHF)	1,06 %	(8,52 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)	1,05 %	(5,19 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 2 décembre 2020)	1,10 %	(5,89 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)	0,60 %	(6,03 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en EUR)	1,97 %	(7,32 %) ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)	1,72 %	(4,24 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 avril 2021)	1,72 %	(5,58 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en GBP)	2,73 %	(6,42 %) ²
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2021)	1,11 %	(7,18 %)
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021)	0,85 %	(8,65 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en SEK)	2,22 %	(9,11 %) ²
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 26 février 2021)	1,59 %	(4,77 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en SGD)	2,61 %	(6,73 %)

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 :

- » Le resserrement des écarts et le portage du crédit de qualité « investment grade », en particulier des titres financiers, ont contribué à la performance absolue.
- » Le resserrement des écarts et la sélection de titres au sein de la dette des marchés émergents, en particulier dans le secteur des services aux collectivités, ont contribué à la performance absolue.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprises à rendement élevé, en particulier dans le secteur automobile, a contribué à la performance absolue, les écarts s'étant resserrés.
- » L'exposition longue modeste à la duration américaine a nui à la performance absolue, les rendements ayant augmenté.
- » L'exposition longue modeste aux parties à court et moyen termes des courbes de taux britannique et européenne a nui à la performance absolue, les rendements ayant augmenté.

Fonds Commodity Real Return Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 août 2006)	(8,91 %)	(0,76 %)
Investisseurs, capitalisation (lancement le 11 août 2011)	(9,01 %)	(2,31 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 septembre 2007)	(9,33 %)	(2,09 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2022)	(8,98 %)	(20,02 %)
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return	(7,79 %)	(1,97 %) ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 juin 2010)	(10,22 %)	(1,30 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 7 mars 2012)	(10,71 %)	(3,84 %)
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en EUR)	(9,19 %)	(2,37 %) ²
Catégories libellées en EUR (non couvertes)		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 11 juin 2021)	(10,94 %)	8,80 %
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (non couvert en EUR)	(9,86 %)	11,08 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} mars 2017)	(9,42 %)	2,83 %
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en GBP)	(8,38 %)	2,34 %
Catégories libellées en GBP (non couvertes)		
Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 novembre 2022)	(13,82 %)	(18,14 %)
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (non couvert en GBP)	(12,77 %)	(17,10 %)
Catégories libellées en SGD		
Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2021)	(9,90 %)	1,23 %
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en SGD)	(8,47 %)	5,60 %

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 (tel que 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 :

- » Le positionnement sur la courbe du point mort d'inflation britannique, en particulier la surpondération de la partie à 5 ans de la courbe, a contribué à la performance, les points morts britanniques à 5 ans ayant augmenté.
- » Les stratégies actives de matières premières, en particulier la sous-pondération du sous-secteur du gaz naturel, ont contribué à la performance relative, le sous-secteur tel que mesuré par le sous-indice Bloomberg Natural Gas Subindex ayant sous-performé l'Indice Bloomberg Commodity Index général.
- » L'exposition aux titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux a contribué à la performance relative, les écarts sur ces titres s'étant 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 nui 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 nominaux japonais a pesé sur la performance relative, les rendements nominaux japonais ayant baissé.
- » La surpondération des obligations couvertes danoises a nui à la performance relative, ces titres ayant sous-performé.

Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 14 octobre 2011)	3,32 %	2,93 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 décembre 2012)	2,86 %	1,35 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ²	2,40 %	1,13 % ²
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2012)	1,17 %	0,35 %
Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index ³	0,61 %	(0,66 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2011)	2,04 %	1,58 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 décembre 2012)	1,64 %	(0,09 %)
Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁴	1,34 %	0,05 % 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 ses actifs nets 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 :

- » L'exposition longue au crédit de qualité « investment grade » a contribué à la performance, en particulier l'exposition aux émetteurs des secteurs de la banque, des fonds de placement immobilier et de la technologie, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue au crédit à rendement élevé a contribué à la performance, en particulier l'exposition aux émetteurs des secteurs de la construction et du divertissement, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue à certaines devises d'Amérique latine a contribué à la performance, car ces devises se sont appréciées par rapport au dollar américain.
- » L'exposition longue à la duration américaine a nuí à la performance, les rendements américains ayant augmenté.
- » L'exposition longue à certains actifs titrisés a nuí à la performance, puisque les écarts sur ces titres se sont creusés.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023^a

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005)	3,10 %	5,04 %
Institutions, distribution (lancement le 8 septembre 2008)	3,05 %	5,02 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 30 avril 2013)	2,94 %	2,03 %
Investisseurs, distribution (lancement le 30 avril 2013)	2,94 %	2,03 %
Administrations, distribution (lancement le 21 juillet 2011)	2,82 %	3,02 %
BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)	2,19 %	(3,51 %)
BN Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)	2,08 %	(3,59 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006)	2,62 %	4,04 %
Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006)	2,57 %	4,12 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 8 juin 2011)	3,04 %	3,35 %
H Institutions, distribution (lancement le 14 mai 2020)	3,03 %	(1,16 %)
M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010)	2,60 %	2,88 %
M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	2,64 %	2,00 %
N Détail, distribution II (lancement le 30 octobre 2020)	2,67 %	(4,56 %)
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	2,47 %	1,31 %
Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)	2,43 %	1,31 %
Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020)	3,21 %	(3,59 %)
Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020)	3,11 %	(3,63 %)
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 (couvert en USD) ^b	3,96 %	4,90 % ^c
Catégories libellées en AUD		
M Détail en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 décembre 2012)	1,76 %	1,98 %
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 (couvert en AUD) ^b	2,98 %	3,01 %
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 20 février 2019)	2,77 %	0,05 %
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 (couvert en CAD) ^b	3,58 %	0,61 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 24 juin 2011)	0,91 %	1,63 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 31 août 2012)	0,83 %	0,87 %
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 11 septembre 2019)	0,48 %	(4,57 %)
Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	0,96 %	(5,79 %)
Catégorie W en CHF (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	0,99 %	(5,75 %)
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 (couvert en CHF) ^b	1,71 %	1,80 % ^c
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 février 2007)	1,83 %	3,75 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 octobre 2007)	1,85 %	3,75 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 juillet 2007)	1,66 %	3,53 %
Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 15 février 2013)	1,65 %	0,62 %
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 juillet 2007)	1,55 %	3,37 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 3 juillet 2007)	1,34 %	2,99 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 16 octobre 2009)	1,35 %	2,36 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	1,17 %	(0,60 %)
Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014)	1,06 %	(0,61 %)

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 :

- » La sélection de titres dans le crédit de qualité « investment grade » a contribué à la performance, en particulier l'exposition à certains émetteurs des secteurs de la banque et des transports, qui ont surperformé.
- » L'exposition tactique à l'indice CDX a contribué à la performance, celui-ci ayant surperformé les obligations au comptant.
- » La sélection de titres dans le crédit à rendement élevé a nuï à la performance, notamment la surpondération d'une banque européenne, qui a sous-performé dans un contexte de crise de confiance, et la surpondération de certains émetteurs du secteur des médias, qui ont également sous-performé.
- » La sélection de titres au sein des marchés émergents a nuï à la performance, en particulier l'exposition à certains promoteurs immobiliers chinois et à la dette de certains émetteurs latino-américains du secteur de l'énergie, qui ont sous-performé.
- » L'exposition tactique au crédit titrisé a nuï à la performance, notamment l'exposition aux créances hypothécaires émises par des organismes gouvernementaux et à certaines créances hypothécaires non émises par des agences, les écarts sur ces titres s'étant creusés.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹ (suite)

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	1,90 %	(5,25 %)
Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	1,92 %	(5,27 %)
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 (couvert en EUR) ³	2,61 %	3,41 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 16 mai 2006)	2,60 %	4,70 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 14 février 2006)	2,53 %	4,64 %
Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 21 juillet 2011)	2,39 %	2,33 %
Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	2,68 %	(4,30 %)
Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	2,68 %	(4,27 %)
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 (couvert en GBP) ³	3,37 %	4,37 % ²
Catégories libellées en JPY		
Administrations en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021)	0,12 %	(11,43 %)
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 (couvert en JPY) ³	1,08 %	(8,91 %)
Catégories libellées en MXN		
Institutions en MXN (couverte), capitalisation (lancement le 9 décembre 2020)	6,82 %	0,30 %
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 (couvert en MXN) ³	7,69 %	2,30 %
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	1,96 %	4,12 %
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2020)	1,70 %	(7,60 %)
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 (couvert en SEK) ³	2,86 %	3,78 % ²
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 7 novembre 2019)	2,41 %	(1,99 %)
Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} mai 2019)	2,18 %	(1,11 %)
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} octobre 2019)	2,08 %	(2,81 %)
Catégorie W en SGD (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	2,48 %	(3,87 %)
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 (couvert en SGD) ³	3,30 %	0,18 % 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.

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 (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global ; à partir du 10 novembre 2015, 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 (couvert en USD).

Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 mai 2011)	3,82 %	3,37 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 février 2014)	3,67 %	2,34 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 16 août 2013)	3,42 %	1,95 %
Catégorie E, distribution (lancement le 31 mai 2011)	3,38 %	2,48 %
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 (couvert en USD) ²	5,02 %	3,26 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 août 2011)	2,68 %	2,27 %
Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 1 ^{er} octobre 2013)	2,69 %	1,23 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 11 août 2011)	2,24 %	1,47 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mai 2013)	2,19 %	0,06 %
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 (couvert en EUR) ²	3,81 %	2,32 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 23 août 2011)	3,52 %	3,14 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2013)	3,49 %	1,91 %
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 (couvert en GBP) ²	4,51 %	3,06 % 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 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 (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch High Yield BB-B Rated Developed Markets Constrained (couvert en USD), JPMorgan EMBI Global ; 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 (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global (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 :

- » La sélection de titres au sein du crédit de qualité « investment grade » a contribué à la performance, en particulier la surpondération d'un émetteur du secteur de la technologie qui a surperformé et la sous-pondération d'un émetteur du secteur des services, qui a sous-performé.
- » L'exposition tactique à l'indice CDX a contribué à la performance, celui-ci ayant surperformé les obligations au comptant.
- » La sélection de titres au sein des marchés émergents a nuí à la performance, en particulier l'exposition à certains promoteurs immobiliers chinois qui ont sous-performé.
- » La sélection de titres au sein du crédit à rendement élevé a nuí à la performance, notamment la surpondération d'un émetteur du secteur des télécommunications, qui a sous-performé.
- » L'exposition tactique au crédit titrisé a nuí à la performance, notamment l'exposition aux créances hypothécaires émises par des organismes gouvernementaux et à certaines créances hypothécaires non émises par des organismes gouvernementaux, les écarts sur ces titres s'étant creusés.

Fonds Diversified Income ESG Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	3,34 %	2,20 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	2,94 %	1,40 %
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Barclays 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	3,86 %	2,74 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	2,15 %	(0,30 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	1,65 %	(1,20 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Barclays 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)	2,51 %	(0,06 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	2,85 %	1,10 %
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Barclays 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)	3,27 %	1,20 %

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 les 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 :

- » La surpondération du crédit de qualité « investment grade » a contribué à la performance, en particulier au cours des quatre premiers mois de l'année, ces titres ayant surperformé par rapport au crédit à rendement élevé et au crédit des marchés émergents.
- » Il n'y a pas eu d'autres contributeurs importants pour ce Fonds.
- » La sélection de titres au sein des marchés émergents a nui à la performance, en particulier l'exposition à la dette d'un émetteur latino-américain dans le secteur des cosmétiques, qui a sous-performé.
- » La sélection de titres au sein du crédit à rendement élevé a nui à la performance, notamment la surpondération d'un émetteur du secteur de la santé, qui a sous-performé.
- » L'exposition tactique au crédit titrisé a nui à la performance, en particulier l'exposition aux titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux, les écarts s'étant creusés.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 15 décembre 2008)	2,43 %	2,29 %
Institutions, distribution (lancement le 22 février 2010)	2,44 %	1,94 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 24 septembre 2010)	2,27 %	1,26 %
Investisseurs, distribution (lancement le 24 septembre 2010)	2,31 %	1,25 %
Administrations, capitalisation (lancement le 21 janvier 2010)	2,20 %	1,42 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 mai 2010)	2,09 %	0,89 %
Catégorie E, distribution (lancement le 11 mai 2010)	2,04 %	0,90 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018)	2,46 %	0,91 %
H Institutions, distribution (lancement le 14 février 2020)	2,41 %	(0,34 %)
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	2,44 %	1,20 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 septembre 2021)	2,93 %	(2,88 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ²	2,40 %	0,85 % ²
Catégories libellées en AUD		
Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 18 mars 2014)	2,14 %	2,74 %
Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,70 %	1,62 %
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 21 septembre 2018)	2,18 %	0,62 %
Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA) ³	2,25 %	1,36 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 8 septembre 2010)	0,40 %	(0,03 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 avril 2011)	0,00 %	(0,99 %)
Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁴	0,61 %	(0,39 %) ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 mai 2009)	1,27 %	1,30 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 23 décembre 2009)	1,34 %	0,89 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 janvier 2011)	1,09 %	0,15 %
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 janvier 2010)	0,99 %	0,32 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 novembre 2009)	0,85 %	(0,01 %)
G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 14 décembre 2010)	0,89 %	(0,35 %)
Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁵	1,34 %	0,10 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 15 décembre 2009)	2,07 %	1,55 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 février 2012)	2,09 %	1,17 %
Catégorie E en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 18 mars 2010)	1,61 %	0,52 %
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁶	2,06 %	0,67 % ²
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 11 avril 2011)	1,49 %	1,67 %
Indice NIBOR Rate Index à 1 mois	1,64 %	1,36 %
Catégories libellées en SEK		
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2011)	1,17 %	0,32 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en SEK) ⁷	1,39 %	0,32 %

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 :

- » L'exposition longue aux taux d'intérêt brésiliens a contribué à la performance, car ces taux 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 au réal brésilien a contribué à la performance, cette devise s'étant appréciée face au dollar américain.
- » L'exposition longue à la durée américaine a nuí à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.
- » L'exposition courte aux taux d'intérêt polonais a nuí à la performance, car ces taux ont baissé.
- » L'exposition longue au yen japonais a nuí à la performance, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.

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.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 25 février 2016)	(1,59 %)	2,21 %
Institutions, distribution II (lancement le 25 février 2016)	(1,66 %)	2,21 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 14 août 2020)	(1,82 %)	(3,04 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 février 2016)	(2,16 %)	1,15 %
Catégorie E, distribution (lancement le 10 septembre 2020)	(2,15 %)	(3,50 %)
Catégorie T, capitalisation (lancement le 20 octobre 2016)	(2,34 %)	0,03 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 1 ^{er} août 2019)	(1,21 %)	1,55 %
Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ²	1,34 %	(0,16 %) ²
Catégories libellées en AUD		
BM Détail en AUD (couverte), distribution II (lancement le 28 avril 2022)	(2,25 %)	(7,71 %)
M Détail en AUD (couverte), distribution II (lancement le 8 avril 2021)	(1,70 %)	(7,19 %)
Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,70 %	1,34 % ²
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 14 mars 2018)	(2,52 %)	0,08 %
Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index ³	0,61 %	(0,49 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 février 2016)	(0,95 %)	3,07 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2019)	(0,96 %)	2,31 %
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁴	2,06 %	0,78 % ²
Catégories libellées en ILS		
Institutions en ILS (couverte), capitalisation (lancement le 27 septembre 2022)	(1,11 %)	(1,70 %)
Taux sans risque au jour le jour du Shekel SHIR	2,13 %	2,88 %
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 30 juillet 2021)	(1,14 %)	(7,23 %)
M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 18 décembre 2020)	(1,59 %)	(5,41 %)
Taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour SORA	1,82 %	1,41 % ²
Catégories libellées en USD		
Institutions en USD (couverte), capitalisation (lancement le 25 février 2016)	(0,37 %)	4,29 %
Institutions en USD (couverte), distribution II (lancement le 30 avril 2021)	(0,42 %)	(5,50 %)
Investisseurs en USD (couverte), capitalisation (lancement le 11 mai 2021)	(0,45 %)	(5,36 %)
BM Détail en USD (couverte), distribution II (lancement le 28 avril 2022)	(1,34 %)	(6,30 %)
Catégorie E en USD (couverte), capitalisation (lancement le 15 mars 2017)	(0,78 %)	2,16 %
Catégorie E en USD (couverte), distribution (lancement le 18 mars 2021)	(0,90 %)	(5,63 %)
Catégorie E en USD (couverte), distribution II (lancement le 9 septembre 2021)	(0,82 %)	(8,68 %)
H Institutions en USD (couverte), capitalisation (lancement le 5 août 2020)	(0,42 %)	(1,65 %)
M Détail en USD (couverte), distribution II (lancement le 8 janvier 2020)	(0,85 %)	0,33 %
Catégorie T en USD (couverte), capitalisation (lancement le 9 septembre 2021)	(1,06 %)	(9,09 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ⁵	2,40 %	1,44 % ²

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, 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 :

- » 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 taïwanaises a contribué à la performance, car les cours ont augmenté.
- » L'exposition longue aux actions sud-coréennes a contribué à la performance, car les cours ont augmenté.
- » L'exposition courte aux actions américaines a nui à la performance, car les cours ont augmenté.
- » L'exposition courte aux actions européennes a nui à la performance, car les cours ont augmenté.
- » L'exposition longue aux actions chinoises a nui à la performance, car les cours ont chuté.

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.

Fonds Emerging Local Bond Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 11 décembre 2007)	9,42 %	2,10 %
Institutions, distribution (lancement le 18 avril 2008)	9,46 %	1,90 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 août 2010)	9,13 %	0,31 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 19 novembre 2008)	8,83 %	2,83 %
Catégorie E, distribution (lancement le 8 juillet 2010)	8,84 %	0,01 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 26 février 2021)	9,21 %	(1,21 %)
Catégorie Z, distribution (lancement le 18 novembre 2008)	9,81 %	4,70 %
Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert)	7,79 %	1,86 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2010)	7,05 %	2,56 %
Institutions en EUR (non couverte), distribution (lancement le 23 juin 2010)	6,94 %	2,00 %
Investisseurs en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 20 décembre 2019)	6,80 %	(0,28 %)
Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2009)	6,41 %	2,99 %
Catégorie E en EUR (non couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2018)	6,46 %	2,79 %
Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR)	5,45 %	3,71 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juin 2008)	3,52 %	5,22 %
Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en GBP)	1,99 %	4,93 %

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 :

- » 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 livre égyptienne a contribué à la performance, la devise égyptienne s'étant affaiblie.
- » L'exposition historique aux obligations locales russes a nuí à la performance, le rouble s'étant affaibli.
- » La sous-pondération de la duration locale à long terme du Mexique a nuí à la performance, car les rendements locaux mexicains ont chuté.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	9,56 %	15,80 %
Institutions, distribution (lancement le 27 juillet 2022)	9,56 %	15,81 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	9,28 %	15,40 %
Investisseurs, distribution (lancement le 27 juillet 2022)	9,37 %	15,44 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	8,93 %	14,70 %
Catégorie E, distribution (lancement le 27 juillet 2022)	9,02 %	14,75 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 23 septembre 2022)	10,03 %	18,50 %
Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	8,87 %	14,99 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	7,19 %	7,40 %
Institutions en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)	7,07 %	7,37 %
Investisseurs en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	6,89 %	7,00 %
Investisseurs en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)	6,89 %	7,02 %
Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	6,61 %	6,40 %
Catégorie E en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)	6,65 %	6,39 %
Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR)	6,50 %	6,67 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 28 juin 2023)	—	(0,70 %)
Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en GBP)	3,00 %	(0,62 %)

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 :

- » 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 portion à 10 ans de la courbe de duration locale chilienne a contribué à la performance, les rendements locaux chiliens ayant chuté.
- » La surpondération du ringgit malaisien a nui à la performance, cette devise s'étant affaiblie.
- » La sous-pondération de la portion à 5 ans de courbe de duration locale mexicaine a nui à la performance, car les rendements locaux mexicains ont chuté.

Fonds Emerging Markets Bond Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 juillet 2001)	4,19 %	7,32 %
Institutions, distribution (lancement le 13 décembre 2001)	4,15 %	6,70 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 25 avril 2002)	4,00 %	5,97 %
Administrations, capitalisation (lancement le 29 mai 2003)	3,94 %	4,91 %
BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)	3,22 %	(2,47 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	3,72 %	3,61 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)	3,71 %	3,77 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 17 octobre 2002)	4,09 %	6,85 %
H Institutions, distribution (lancement le 3 septembre 2020)	4,03 %	(4,84 %)
M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010)	3,72 %	2,26 %
M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	3,76 %	1,48 %
Catégorie Z, distribution (lancement le 18 novembre 2008)	4,56 %	6,85 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	3,81 %	6,59 % ²
Catégories libellées en AUD		
M Détail en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 décembre 2012)	2,74 %	0,85 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en AUD)	2,80 %	1,73 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 16 décembre 2005)	2,03 %	2,59 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en CHF)	1,58 %	2,76 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2002)	2,88 %	5,29 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 20 décembre 2010)	2,87 %	1,85 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 décembre 2019)	2,70 %	(4,89 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	2,46 %	2,31 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en EUR)	2,46 %	5,17 % ²
Catégories libellées en EUR (non couvertes)		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 9 février 2018)	1,87 %	2,56 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (non couvert en EUR)	1,55 %	2,44 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 5 février 2004)	3,66 %	4,98 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	3,73 %	4,00 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en GBP)	3,21 %	5,20 % ²
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2018)	3,54 %	0,46 %
Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 15 février 2007)	3,11 %	2,71 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en SGD)	3,14 %	3,98 % 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 :

- » La surpondération de la dette souveraine et quasi-souveraine ukrainienne a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La surpondération de la dette souveraine et quasi-souveraine nigérienne a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La surpondération de la dette souveraine sri lankaise 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 surpondération de la dette souveraine égyptienne a pesé sur 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 net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 16 avril 2010)	4,31 %	2,99 %
Institutions, distribution (lancement le 10 juillet 2019)	4,37 %	(2,45 %)
Administrations, capitalisation (lancement le 10 juillet 2019)	4,10 %	(2,94 %)
Administrations, distribution (lancement le 10 juillet 2019)	4,10 %	(2,95 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 5 février 2021)	4,02 %	(8,79 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 5 février 2021)	3,86 %	(8,85 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 1 ^{er} mars 2023)	—	3,90 %
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified ³	3,91 %	3,46 % ²
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 9 avril 2021)	2,04 %	(9,59 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en CHF) ³	1,68 %	(9,25 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 octobre 2013)	3,09 %	0,02 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2017)	3,06 %	(2,81 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 août 2018)	2,59 %	(2,84 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en EUR) ³	2,56 %	0,51 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2019)	3,84 %	(4,36 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en GBP) ³	3,31 %	(4,64 %)
Catégories libellées en GBP (non couvertes)		
Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 décembre 2020)	(1,28 %)	(5,92 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (non couvert en GBP) ³	(1,68 %)	(5,61 %)
Catégories libellées en NOK		
Investisseurs en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 17 mars 2014)	3,13 %	0,76 %
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en NOK) ³	2,86 %	1,31 %
Catégories libellées en SEK		
Investisseurs en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 6 février 2014)	3,06 %	(0,22 %)
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021)	2,98 %	(12,16 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en SEK) ³	2,82 %	0,55 % 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 responsabilité du Conseiller en investissement conçu pour prendre en compte les facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) et qui comprend un processus de filtrage éthique fourni 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 :

- » La surpondération de la dette d'entreprises ukrainienne a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La surpondération de la durée de la République dominicaine a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant chuté.
- » La surpondération de la dette souveraine sri lankaise a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La sous-pondération des écarts des marchés émergents a nui à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » La surpondération de la dette souveraine égyptienne a pesé sur la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 12 novembre 2009)	1,81 %	3,39 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 février 2012)	1,37 %	1,52 %
Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	3,27 %	4,69 % ²
Catégories libellées en CHF		
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 25 mai 2012)	(0,83 %)	(0,39 %)
Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (couvert en CHF)	1,08 %	1,75 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 19 février 2010)	0,62 %	2,00 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mars 2010)	0,18 %	0,97 %
Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (couvert en EUR)	1,97 %	3,23 % 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 :

- » La sélection de titres au sein de la dette d'entreprises ukrainienne a contribué à la performance, les prix de certains titres ayant augmenté.
- » La sélection de titres au sein de la dette d'entreprises saoudienne a contribué à la performance, les prix de certains titres ayant augmenté.
- » La sélection de titres au sein de la dette d'entreprises brésilienne a nui à la performance, les prix d'un certain émetteur ayant chuté.
- » L'exposition historique à la dette russe a nui à la performance, les entreprises russes ayant sous-performé l'indice.
- » La sélection de titres parmi les entreprises chinoises a pesé sur la performance, certains titres immobiliers ayant subi des baisses de prix.

Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 4 juin 2019)	5,86 %	2,00 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 8 juin 2022)	6,19 %	6,03 %
50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD)	5,80 %	(0,78 %) ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 4 juin 2019)	4,01 %	0,29 %
Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 19 avril 2022)	3,53 %	(2,68 %)
50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index (couvert en EUR) / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR)	3,96 %	(1,43 %) ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (partiellement couverte), distribution (lancement le 29 mars 2022)	3,52 %	(0,80 %)
50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index (couvert en GBP) / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en GBP)	2,61 %	(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.

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 :

- » La sous-pondération de la duration américaine a contribué à la performance, les rendements américains ayant augmenté.
- » 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 du rand sud-africain a contribué à la performance, cette devise s'étant affaiblie.
- » La sous-pondération du zloty polonais a nui à la performance, cette devise s'étant raffermie.
- » La sous-pondération de la couronne tchèque a nui à la performance, cette devise s'étant raffermie.

Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Catégorie E, capitalisation (lancement le 19 novembre 2008)	4,73 %	1,32 %
Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert)	3,96 %	1,20 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2010)	2,91 %	2,80 %
Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2009)	2,40 %	2,26 %
Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en EUR)	1,70 %	2,82 % 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 :

- » 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 peso colombien a contribué à la performance, cette devise s'étant raffermie.
- » La sous-pondération de la durée locale polonaise a nui à la performance, les rendements locaux ayant chuté.
- » L'exposition hors indice aux entreprises brésiliennes a nui à la performance en raison de la baisse des prix de certains titres.

Fonds PIMCO ESG Income Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2021)	1,49 %	(2,05 %)
Institutions, distribution (lancement le 29 avril 2021)	1,54 %	(2,05 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 29 avril 2021)	1,08 %	(2,91 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 29 avril 2021)	1,06 %	(2,93 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	(4,80 %)
Catégories libellées en AUD		
Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 novembre 2021)	0,62 %	(4,31 %)
Catégorie R en AUD (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)	0,52 %	(3,16 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD)	1,13 %	(5,88 %) ²
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 29 avril 2021)	(0,66 %)	(4,50 %)
Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)	(1,11 %)	(5,32 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF)	(0,16 %)	(7,40 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 avril 2021)	0,22 %	(3,82 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 21 mai 2021)	0,25 %	(3,96 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 juin 2021)	(0,11 %)	(5,20 %)
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)	(0,20 %)	(4,67 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)	0,74 %	(6,73 %) ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)	1,07 %	(2,74 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)	1,51 %	(5,64 %)
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} mars 2023)	—	0,29 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en NOK)	1,12 %	1,64 %
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 29 octobre 2021)	0,36 %	(4,83 %)
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 12 mai 2022)	0,11 %	(2,35 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SEK)	0,99 %	(8,72 %) ²
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)	0,98 %	(2,34 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD)	1,40 %	(5,22 %)

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 :

- » 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 non émis par des organismes gouvernementaux ont contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue à la durée américaine a nuí à la performance, les rendements américains ayant augmenté.
- » Les positions en titres adossés à des créances hypothécaires commerciales et émis par des organismes gouvernementaux ont pesé sur la performance, puisque les écarts sur ces titres se sont creusés.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 décembre 1998)	2,18 %	3,28 %
Institutions, distribution (lancement le 7 janvier 2003)	2,09 %	2,92 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 8 mai 2002)	1,99 %	2,86 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	1,73 %	1,56 %
Catégorie E, distribution (lancement le 10 octobre 2005)	1,70 %	1,35 %
Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	2,33 %	3,09 % ²
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2006)	1,26 %	1,69 %
Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index (couvert en CHF)	1,44 %	1,73 %

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 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, 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 :

- » La sous-pondération de la duration du bloc euro, principalement appliquée sur les parties courte et très longue de la courbe, tout en maintenant une surpondération dans la partie médiane, a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt ayant augmenté dans les parties courte et très longue de la courbe, alors qu'ils chutaient dans la partie médiane.
- » L'exposition longue à des produits titrisés, plus précisément aux titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles britanniques et aux prêts garantis (CLO) européens de haute qualité, a contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » La sélection de titres au sein des titres financiers senior a contribué à la performance relative, car les expositions aux obligations de certains émetteurs financiers et de courtage ont surperformé.
- » La sélection de titres au sein des titres financiers subordonnés a nui à la performance relative, l'exposition à une certaine banque suisse ayant sous-performé.
- » L'exposition courte à la duration japonaise a nui à la performance relative, les taux d'intérêt ayant chuté.
- » L'exposition longue aux créances hypothécaires danoises a pesé sur la performance relative, les écarts s'étant creusés.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Catégories libellées en EUR	6 mois	Lancement de la catégorie
Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2008)	2,95 %	2,51 %
Institutions, distribution II (lancement le 1 ^{er} octobre 2013)	2,98 %	0,99 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 mai 2010)	2,50 %	1,05 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 7 juin 2019)	3,03 %	(2,99 %)
H Institutions, distribution II (lancement le 7 juin 2019)	2,99 %	(3,00 %)
Indice Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	2,10 %	2,35 % 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.

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, 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 :

- » Les stratégies macro, et en particulier le positionnement sur la durée en euro et en dollar américain, ont contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté et l'inversion des deux courbes s'étant accentuée.
- » La sélection de titres au sein des secteurs bancaire et du courtage a contribué à la performance, la surpondération de la dette senior émise par une banque suisse ayant surperformé suite à son acquisition par un concurrent mieux noté.
- » La sous-pondération du secteur lié aux gouvernements en début d'année a contribué à la performance, le secteur ayant sous-performé en raison des anticipations d'une offre élevée en 2023.
- » L'exposition aux obligations danoises couvertes en début d'année a nuí à la performance, les écarts s'étant creusés.
- » La sélection de titres au sein des services aux collectivités a nuí à la performance, car la surpondération d'une société spécialisée dans l'eau au Royaume-Uni a sous-performé, sur fond d'inquiétudes quant à la situation financière de cette société.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Catégories libellées en EUR	6 mois	Lancement de la catégorie
Institutions, capitalisation (lancement le 28 février 2011)	3,02 %	2,95 %
Institutions, distribution (lancement le 28 février 2011)	3,02 %	2,96 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 13 décembre 2019)	2,92 %	(2,38 %)
Investisseurs, distribution (lancement le 29 mai 2012)	2,83 %	2,54 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 février 2011)	2,56 %	2,03 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 février 2011)	2,59 %	2,03 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	2,39 %	(0,18 %)
Catégorie T, distribution (lancement le 30 septembre 2014)	2,44 %	(0,18 %)
Indice Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	1,65 %	1,53 % 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, 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 :

- » L'exposition longue au crédit de qualité « investment grade » et à rendement élevé a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition longue au crédit titrisé, plus précisément aux titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux aux États-Unis, et adossés à des créances hypothécaires résidentielles européennes, et aux prêts garantis (CLO), a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » L'exposition longue à un panier sélectionné de devises des marchés émergents a contribué à la performance, car ces devises se sont appréciées face à l'euro.
- » L'exposition longue à la durée américaine a nuí à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.
- » L'exposition longue à la durée du bloc euro a nuí à la performance, car les taux d'intérêt européens ont augmenté.
- » L'exposition courte à la durée japonaise a nuí à la performance, car les taux d'intérêt japonais ont augmenté.

Fonds Euro Long Average Duration Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Catégories libellées en EUR	6 mois	Lancement de la catégorie
Institutions, capitalisation (lancement le 21 avril 2006)	4,41 %	4,07 %
Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index ²	3,66 %	3,00 %

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

² 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 euros. 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 euros.

Aperçu du Fonds

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

- » La sous-pondération de la durée du bloc euro, principalement appliquée à la partie courte de la courbe, ainsi que la sélection des instruments, ont contribué à la performance, en raison de la hausse des rendements de la zone euro et de la pentification de la partie à court terme de la courbe.
- » L'exposition longue à des produits titrisés, plus précisément aux titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles britanniques et aux prêts garantis (CLO) européens de haute qualité, a contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » Le positionnement au Japon, associant une sous-pondération de la durée japonaise et une surpondération du yen japonais, a nui à la performance, les taux d'intérêt japonais ayant chuté et le yen s'étant affaibli par rapport au dollar américain (la devise de financement).
- » L'exposition longue aux créances hypothécaires danoises a pesé sur la performance relative, les écarts s'étant creusés.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Catégories libellées en EUR	6 mois	Lancement de la catégorie
Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2006)	1,61 %	1,06 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	1,25 %	0,29 %
Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ²	1,34 %	0,76 % 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 au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 1 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 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, 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 :

- » L'exposition longue au crédit titrisé, principalement sous la forme de titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles européennes et de prêts garantis (CLO), 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, les écarts s'étant resserrés.
- » La sélection au sein des obligations couvertes a contribué à la performance.
- » Le positionnement sur la courbe de la durée du bloc euro a nui à la performance, les taux d'intérêt européens ayant augmenté sur la partie à court terme de la courbe.
- » L'exposition longue à la durée américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.
- » L'exposition longue au yen japonais a nui à la performance, car cette devise s'est dépréciée par rapport à l'euro.

Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Catégories libellées en EUR	6 mois	Lancement de la catégorie
Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2020)	4,73 %	0,55 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 22 décembre 2022)	4,20 %	4,20 %
Catégorie E, distribution (lancement le 17 avril 2023)	—	1,35 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 31 janvier 2020)	5,06 %	1,10 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	4,44 %	(0,83 %) 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 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 rendement élevé 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 rendement élevé 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.

Aperçu du Fonds

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

- » La sélection de titres dans le secteur de la santé a contribué à la performance, car certains émetteurs surpondérés ont surperformé tandis qu'un émetteur sous-pondéré a sous-performé.
- » La sélection de titres dans le secteur automobile a contribué à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé.
- » La sélection de titres dans le secteur de la finance et de l'assurance a contribué à la performance, certains émetteurs sous-pondérés ayant sous-performé.
- » 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 produits chimiques a nuï à la performance, car un émetteur surpondéré a sous-performé.

Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 5 juillet 2011)	0,45 %	0,84 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 mars 2013)	0,32 %	(0,55 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 8 janvier 2020)	0,42 %	(1,20 %)
Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ³	1,35 %	1,05 % 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 :

- » L'exposition longue au crédit titrisé, plus précisément aux titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles européennes et aux prêts garantis (CLO), a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » L'exposition longue aux titres financiers senior a contribué à la performance, les écarts s'étant resserrés.
- » Il n'y a pas eu d'autres contributeurs importants pour ce Fonds.
- » L'exposition longue à la durée américaine a nuí à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.
- » L'exposition courte à la durée japonaise a nuí à la performance, car les taux d'intérêt japonais ont augmenté.
- » L'exposition longue aux obligations couvertes danoises a nuí à la performance, les écarts s'étant creusés.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 9 juin 2009)	1,81 %	2,17 %
Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres)	2,14 %	1,70 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (partiellement couverte), distribution (lancement le 2 août 2011)	(0,22 %)	1,06 %
Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en CHF) (clôture de la Bourse de Londres)	0,05 %	0,58 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 24 mai 2010)	0,70 %	1,99 %
Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 6 mai 2010)	0,26 %	0,99 %
Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en EUR) (clôture de la Bourse de Londres)	1,03 %	1,59 % ²
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 5 mars 2012)	3,99 %	3,43 %
Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en NOK) (clôture de la Bourse de Londres)	4,37 %	3,02 %

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 :

- » La sous-pondération de la duration américaine a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt ayant augmenté.
- » La surpondération des titres financiers senior a contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » L'exposition choisie à la dette externe des marchés émergents a contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » La sous-pondération des pays de la périphérie de l'Europe, plus précisément des obligations de l'État italien, a nui à la performance relative, les écarts par rapport aux Bunds allemands s'étant resserrés.
- » La sous-pondération des obligations d'entreprises non financières de qualité « investment grade » a nui à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » La surpondération de la duration britannique a nui à la performance relative, les taux d'intérêt ayant augmenté.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 12 mars 1998)	2,97 %	4,78 %
Institutions, distribution (lancement le 18 avril 2001)	2,94 %	4,44 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 1 ^{er} mars 1999)	2,78 %	4,26 %
Investisseurs, distribution (lancement le 23 janvier 2001)	2,78 %	4,08 %
Administrations, capitalisation (lancement le 14 juin 2004)	2,68 %	3,74 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	2,50 %	3,21 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)	2,49 %	3,17 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002)	2,87 %	4,10 %
H Institutions, distribution (lancement le 14 février 2020)	2,78 %	(1,67 %)
M Détail, distribution II (lancement le 26 avril 2017)	2,49 %	0,52 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	2,26 %	0,96 %
Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)	2,32 %	0,97 %
Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020)	3,01 %	(2,71 %)
Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020)	2,94 %	(2,75 %)
Catégorie W, distribution II (lancement le 23 février 2023)	—	1,50 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD) ²	2,96 %	4,06 % ²
Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)		
Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 13 décembre 2002)	1,45 %	3,64 %
Institutions (exposition au risque de change), distribution (lancement le 23 mars 2006)	1,41 %	3,19 %
Catégorie E (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 19 mai 2010)	1,04 %	1,20 %
Catégorie E (exposition au risque de change), distribution (lancement le 19 mai 2010)	0,98 %	1,20 %
H Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 26 février 2021)	1,35 %	(7,75 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en USD) ³	1,43 %	2,82 % ²
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 21 septembre 2018)	2,57 %	0,76 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CAD) ³	2,64 %	0,60 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 8 mai 2003)	0,80 %	2,24 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 10 avril 2003)	0,79 %	2,28 %
Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 juin 2011)	0,61 %	1,24 %
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 13 juin 2018)	0,34 %	(2,20 %)
Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	0,93 %	(4,79 %)
Catégorie W en CHF (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	0,83 %	(4,82 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CHF) ³	0,75 %	1,46 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 4 avril 2003)	1,71 %	3,22 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 avril 2005)	1,72 %	3,05 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 février 2005)	1,52 %	2,70 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	1,25 %	2,24 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2016)	1,26 %	(0,87 %)
G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2012)	1,26 %	0,02 %
Catégorie R en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	1,52 %	0,65 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	1,08 %	(0,72 %)
Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	1,73 %	(4,26 %)
Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	1,66 %	(4,26 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en EUR) ³	1,66 %	2,37 % ²

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 :

- » La sous-pondération de la partie à court terme de la courbe de taux américaine a contribué à la performance relative, car les taux d'intérêt ont augmenté.
- » La surpondération des titres financiers senior a contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » L'exposition longue au crédit titrisé, principalement sous la forme de titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles non émises par des organismes gouvernementaux aux États-Unis et d'obligations hypothécaires garanties européennes, a contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » La sous-pondération de la duration japonaise a nuí à la performance relative, car les taux d'intérêt ont chuté.
- » L'exposition longue au yen japonais a nuí à la performance relative, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.
- » La surpondération de la duration britannique a nuí à la performance relative, les taux d'intérêt ayant augmenté.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹ (suite)

	6 mois	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)	(0,70) %	2,38 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en EUR) ³	(0,78) %	1,89 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2003)	2,47 %	4,21 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} juin 2004)	2,48 %	4,20 %
Investisseurs en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 14 avril 2005)	2,32 %	3,56 %
Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	2,48 %	(3,26) %
Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	2,58 %	(3,24) %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en GBP) ³	2,43 %	3,41 % ²
Catégories libellées en GBP (exposition au risque de change)		
Institutions en GBP (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 9 mars 2018)	(4,03) %	0,45 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP) ³	(4,03) %	0,23 %
Catégories libellées en HKD		
M Détail en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 26 avril 2017)	2,94 %	0,63 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en HKD) ³	3,38 %	1,22 %
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2005)	1,91 %	4,18 %
Investisseurs en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 26 juillet 2006)	1,74 %	4,14 %
Catégorie W en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 13 avril 2021)	1,96 %	(4,64) %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NOK) ³	2,02 %	3,33 % ²
Catégories libellées en NZD		
Institutions en NZD (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} novembre 2004)	2,73 %	6,08 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NZD) ³	2,73 %	5,20 %
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 novembre 2004)	1,81 %	3,37 %
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2021)	1,56 %	(6,55) %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SEK) ³	1,88 %	2,46 % ²
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 7 août 2009)	2,33 %	4,13 %
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 février 2023)	—	1,05 %
M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 23 février 2023)	—	0,70 %
Catégorie W en SGD (couverte), distribution II (lancement le 23 février 2023)	—	1,12 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SGD) ³	2,32 %	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.

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 net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)	2,64 %	1,30 %
Institutions, distribution (lancement le 3 avril 2020)	2,63 %	(1,14 %)
Investisseurs, capitalisation (lancement le 7 novembre 2018)	2,48 %	0,74 %
Catégorie E, distribution (lancement le 8 mars 2019)	2,11 %	(0,43 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD)	2,96 %	1,17 % ²
Catégories libellées en AUD		
Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017)	2,07 %	1,33 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en AUD)	2,07 %	0,68 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)	0,44 %	(1,25 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} septembre 2022)	0,10 %	(3,30 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CHF)	0,75 %	(1,41 %) ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)	1,28 %	(0,76 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017)	1,32 %	(0,76 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 février 2017)	1,01 %	(1,62 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en EUR)	1,66 %	(0,89 %) ²
Catégories libellées en EUR (exposition au risque de change)		
Institutions en EUR (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 29 novembre 2021)	(1,02 %)	(8,02 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en EUR)	(0,78 %)	(7,87 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 3 juin 2020)	2,10 %	(2,61 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017)	2,18 %	0,27 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en GBP)	2,43 %	0,14 % ²
Catégories libellées en GBP (exposition au risque de change)		
Institutions en GBP (exposition au risque de change), distribution (lancement le 4 août 2022)	(4,36 %)	(8,18 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP)	(4,03 %)	(8,10 %)
Catégories libellées en GBP (non couvertes)		
Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 décembre 2020)	(2,88 %)	(2,71 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP)	(2,58 %)	(1,99 %)
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)	1,58 %	0,41 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NOK)	2,02 %	0,35 %
Catégories libellées en NZD		
Institutions en NZD (couverte), distribution (lancement le 5 avril 2017)	2,45 %	1,03 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NZD)	2,73 %	1,00 %
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 20 mai 2021)	1,51 %	(5,73 %)
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 18 mai 2023)	—	(0,19 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SEK)	1,88 %	(5,19 %) ²

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 :

- » La sous-pondération de la partie à court terme de la courbe américaine a contribué à la performance relative, car les taux d'intérêt ont augmenté.
- » La surpondération des titres financiers senior a contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » Le positionnement sur la courbe au sein du bloc euro, à savoir la sous-pondération de la partie à court terme, où les taux d'intérêt ont augmenté, et la surpondération de la partie à 10 ans, où les taux d'intérêt ont baissé, a contribué à la performance relative.
- » La sous-pondération de la duration japonaise a nui à la performance relative, car les taux d'intérêt ont chuté.
- » La sous-pondération de la duration chinoise a nui à la performance relative, car les taux d'intérêt ont chuté.
- » L'exposition longue au yen japonais a nui à la performance relative, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.

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 net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 mars 2003)	3,49 %	4,23 %
Institutions, distribution (lancement le 9 novembre 2005)	3,46 %	4,27 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 28 février 2006)	3,32 %	3,86 %
Administrations, capitalisation (lancement le 14 septembre 2004)	3,23 %	3,86 %
Catégorie E, distribution (lancement le 30 avril 2008)	3,07 %	3,37 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018)	3,38 %	0,87 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 30 octobre 2019)	3,77 %	(0,22 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD) ³	3,61 %	3,34 % ²
Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)		
Catégorie E (exposition au risque de change), distribution (lancement le 4 octobre 2016)	0,31 %	(2,47 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (non couvert en USD) ³	0,83 %	(2,12 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 4 avril 2006)	2,31 %	3,45 %
Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en EUR) ³	2,36 %	2,35 %

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 :

- » La sous-pondération de la duration américaine a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt ayant augmenté.
- » La surpondération des titres financiers senior a contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés.
- » L'exposition longue au crédit titrisé, principalement sous la forme de prêts garantis américains et de titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles (RMBS) non émis par des organismes gouvernementaux aux États-Unis et au Royaume-Uni, a contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » La sous-pondération des obligations d'entreprises non financières de qualité « investment grade » a nui à la performance relative, les écarts s'étant 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 surpondération de la duration britannique a nui à la performance relative, les taux d'intérêt ayant augmenté.

Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 15 avril 2009)	6,23 %	5,35 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 24 septembre 2010)	6,08 %	3,50 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 22 juin 2009)	5,60 %	3,86 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 janvier 2011)	5,64 %	2,40 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2022)	6,15 %	0,09 %
H Institutions, distribution (lancement le 29 avril 2022)	6,12 %	0,08 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 6 juillet 2016)	6,73 %	6,68 %
60 % de l'Indice MSCI All Country World Index / 40 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en USD	9,49 %	7,68 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 avril 2009)	5,22 %	4,44 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 22 juin 2009)	4,54 %	2,95 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 24 juin 2011)	4,65 %	1,36 %
60 % de l'Indice MSCI All Country World Index couvert en EUR et 40 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en EUR	8,34 %	6,57 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 7 avril 2010)	6,10 %	3,72 %
60 % de l'Indice MSCI All Country World Index couvert en GBP et 40 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en GBP	9,08 %	5,94 %

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 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 :

- » L'exposition à certaines devises des marchés émergents, en particulier la surpondération du real brésilien et du peso mexicain et la sous-pondération du yuan chinois, a contribué à la performance relative, car le real brésilien et le peso mexicain se sont appréciés et le yuan chinois s'est déprécié par rapport au dollar américain.
- » L'exposition au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » et à rendement élevé, en particulier la surpondération et la sélection de titres dans le secteur financier, a contribué à la performance relative, car ces titres ont dégagé une performance positive au cours de la période.
- » La sous-pondération globale des actions américaines a nui à la performance relative, car elles ont dégagé une performance positive au cours de la période.
- » L'exposition aux actions des marchés émergents, en particulier certaines positions dans la catégorie des biens de consommation discrétionnaire au sein des actions chinoises, a nui à la performance, car ces titres ont dégagé une performance négative.
- » La sous-pondération globale des actions de la zone euro a nui à la performance relative, car elles ont dégagé une performance positive au cours de la période.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005)	4,70 %	5,71 %
Institutions, distribution (lancement le 30 décembre 2005)	4,79 %	5,71 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 22 juin 2016)	4,51 %	3,51 %
Administrations, capitalisation (lancement le 27 juin 2008)	4,43 %	5,21 %
Administrations, distribution (lancement le 11 décembre 2015)	4,47 %	3,96 %
BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)	3,74 %	(0,23 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006)	4,24 %	4,67 %
Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006)	4,25 %	4,74 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 29 août 2008)	4,66 %	5,67 %
H Institutions, distribution (lancement le 22 mars 2013)	4,62 %	3,68 %
M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010)	4,18 %	4,06 %
M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	4,35 %	2,81 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	4,63 %	3,84 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	4,02 %	2,51 %
Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)	4,08 %	2,51 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD ²	5,10 %	6,06 % ²
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 16 février 2010)	2,58 %	3,74 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 31 août 2012)	2,43 %	2,32 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en CHF ²	2,84 %	4,11 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mai 2008)	3,42 %	4,29 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	3,40 %	4,55 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 janvier 2011)	3,24 %	3,07 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	2,97 %	3,53 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2016)	3,00 %	0,84 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en EUR ²	3,76 %	4,72 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 mai 2012)	4,21 %	3,92 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	4,14 %	5,28 %
Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 juin 2009)	3,76 %	5,09 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en GBP ²	4,50 %	5,47 % ²
Catégories libellées en SGD		
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 25 avril 2016)	3,61 %	2,59 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en SGD ²	4,45 %	3,97 %

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 :

- » La surpondération et la sélection de titres dans le secteur des jeux et de l'hébergement ont contribué à la performance, car le secteur a surperformé le marché dans son ensemble dans un contexte de forte demande des consommateurs pour les services de loisirs et de divertissement.
- » La sélection de titres dans le secteur des biens de consommation non cycliques a contribué à la performance, un émetteur surpondéré ayant surperformé.
- » La sélection de titres dans le secteur de la finance et de l'assurance a nui à la performance, l'exposition à la dette subordonnée, et en particulier celle d'une banque suisse, ayant sous-performé.
- » La surpondération et la sélection de titres dans le secteur de la chimie ont nui à la performance, car le secteur a sous-performé le marché dans son ensemble tandis qu'un émetteur surpondéré a sous-performé.
- » La sélection de titres dans le secteur des médias, du divertissement et de l'édition a nui à la performance, car certains émetteurs surpondérés ont sous-performé.

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.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 18 avril 2008)	3,44 %	4,12 %
Institutions, distribution (lancement le 23 juillet 2003)	3,38 %	4,34 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 15 février 2005)	3,25 %	3,72 %
Investisseurs, distribution (lancement le 22 janvier 2009)	3,19 %	4,36 %
Administrations, capitalisation (lancement le 21 janvier 2009)	3,17 %	4,20 %
Administrations, distribution (lancement le 21 janvier 2009)	3,07 %	4,20 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 10 décembre 2008)	2,99 %	3,98 %
Catégorie E, distribution (lancement le 30 avril 2008)	2,96 %	3,13 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 29 août 2008)	3,36 %	4,08 %
H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018)	3,35 %	0,47 %
M Détail, distribution (lancement le 28 septembre 2012)	2,96 %	1,40 %
M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	2,95 %	1,53 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	3,30 %	1,90 %
Catégorie R, distribution (lancement le 30 novembre 2012)	3,28 %	1,91 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	2,73 %	0,61 %
Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020)	3,48 %	(3,93 %)
Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020)	3,37 %	(3,92 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)	3,00 %	3,65 % ²
Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)		
Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 2 août 2013)	3,91 %	1,27 %
Institutions (exposition au risque de change), distribution (lancement le 6 septembre 2016)	3,85 %	0,09 %
H Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 26 février 2021)	3,72 %	(7,37 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (non couvert en USD)	3,42 %	1,20 % ²
Catégories libellées en AUD		
Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 7 avril 2020)	2,53 %	(1,61 %)
Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 25 juin 2018)	2,36 %	(0,54 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en AUD)	2,03 %	0,35 % ²
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 10 décembre 2009)	1,22 %	1,90 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 6 février 2015)	1,24 %	(0,72 %)
Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 10 mai 2011)	1,01 %	0,75 %
Investisseurs en CHF (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009)	0,94 %	2,67 %
Administrations en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 31 janvier 2013)	0,94 %	(0,36 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 6 mars 2012)	0,81 %	(0,06 %)
Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	1,21 %	(6,03 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CHF)	0,74 %	2,27 % ²
Catégories libellées en CZK		
Institutions en CZK (couverte), distribution (lancement le 19 mai 2015)	4,26 %	1,14 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CZK)	3,81 %	1,33 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 septembre 2003)	2,08 %	3,37 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 15 septembre 2008)	2,09 %	3,27 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 mai 2006)	1,96 %	2,83 %
Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009)	2,00 %	3,25 %
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 17 février 2009)	1,87 %	2,98 %
Administrations en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 février 2009)	1,94 %	2,98 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	1,66 %	2,22 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 9 septembre 2010)	1,71 %	0,99 %

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 :

- » Les stratégies macro, et en particulier la position sur la durée dans les marchés développés, ont contribué à la performance.
- » La surpondération et la sélection de titres dans le secteur des transports ont contribué à la performance, car certains émetteurs surpondérés ont surperformé dans un contexte de hausse continue de l'activité dans le segment des voyages.
- » 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 nuí 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 nuí à la performance, car certaines anciennes positions russes ont sous-performé.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹ (suite)

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	1,93 %	0,35 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	1,46 %	(1,13 %)
Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	2,17 %	(5,52 %)
Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	2,11 %	(5,52 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en EUR)	1,64 %	2,65 % ²
Catégories libellées en EUR (exposition au risque de change)		
Institutions en EUR (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 16 août 2012)	1,65 %	2,38 %
Catégorie E en EUR (exposition au risque de change), distribution (lancement le 12 décembre 2018)	1,22 %	(0,08 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (non couvert en EUR)	1,17 %	2,50 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 2 septembre 2005)	2,88 %	3,75 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 11 juillet 2008)	2,86 %	3,88 %
Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009)	2,70 %	3,89 %
Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 janvier 2009)	2,63 %	3,71 %
Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mars 2009)	2,47 %	3,39 %
Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	2,76 %	1,22 %
Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	2,94 %	(4,53 %)
Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	2,85 %	(4,51 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en GBP)	2,42 %	3,18 % ²
Catégories libellées en HKD		
Administrations en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017)	3,58 %	0,14 %
M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017)	3,37 %	(0,24 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) libellé en HKD	3,41 %	1,17 %
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 18 janvier 2012)	2,38 %	2,78 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en NOK)	2,01 %	2,59 %
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 4 décembre 2009)	2,30 %	2,87 %
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 13 décembre 2012)	1,97 %	0,33 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SEK)	1,89 %	2,45 % ²
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)	2,73 %	1,58 %
Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)	2,57 %	(0,11 %)
Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 22 septembre 2017)	2,53 %	(0,52 %)
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 18 juillet 2012)	2,38 %	1,35 %
Catégorie W en SGD (couverte), distribution (lancement le 13 octobre 2020)	2,75 %	(4,65 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SGD)	2,31 %	2,19 % 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.

Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)	2,59 %	1,39 %
Institutions, distribution (lancement le 19 juillet 2019)	2,59 %	(0,68 %)
Investisseurs, capitalisation (lancement le 4 mai 2021)	2,45 %	(5,86 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 février 2020)	2,19 %	(3,53 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 28 février 2020)	2,17 %	(3,53 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 20 juin 2019)	2,88 %	0,05 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)	3,00 %	1,21 % ²
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)	0,43 %	(1,21 %)
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)	0,42 %	(4,83 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020)	0,00 %	(5,71 %)
Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)	(0,04 %)	(5,69 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CHF)	0,74 %	(1,42 %) ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)	1,36 %	(0,68 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)	1,43 %	(4,29 %)
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 janvier 2023)	—	0,50 %
Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 5 janvier 2023)	—	0,44 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020)	0,96 %	(5,16 %)
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)	0,85 %	(5,19 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en EUR)	1,64 %	(0,89 %) ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)	2,11 %	0,29 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} mai 2019)	2,09 %	(0,78 %)
Catégorie E en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020)	1,65 %	(4,32 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en GBP)	2,42 %	0,12 % ²
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 3 novembre 2022)	1,48 %	5,23 %
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 27 novembre 2019)	1,22 %	(3,47 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SEK)	1,89 %	(3,03 %) 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 :

- » La sélection de titres dans la dette extérieure des marchés émergents a contribué à la performance, car la surpondération des obligations ESG de certains émetteurs souverains, entités liées à un gouvernement et émetteurs privés a surperformé.
- » La sélection de titres dans le secteur automobile a contribué à la performance, car l'exposition aux obligations ESG de certains fournisseurs automobiles a surperformé.
- » Les stratégies macro, et en particulier la duration et le positionnement sur la courbe aux États-Unis, ont nui à la performance.
- » La sélection de titres dans le secteur bancaire a nui à la performance, l'exposition à certaines obligations senior et subordonnées ayant sous-performé dans un contexte de volatilité générale du secteur bancaire.
- » La surpondération de sociétés d'investissement immobilier a nui à la performance, car le secteur a sous-performé le marché dans son ensemble sur fond d'inquiétudes quant à l'impact de la hausse des taux d'intérêt et du resserrement des conditions financières.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 18 février 2014)	1,27 %	1,92 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 5 octobre 2016)	1,14 %	2,16 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 18 février 2014)	0,83 %	1,00 %
Indice Bloomberg World Government inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD)	1,54 %	1,94 % ²
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)	(0,81 %)	(0,22 %)
Indice Bloomberg World Government inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en CHF)	(0,60 %)	(0,26 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)	0,10 %	0,27 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 janvier 2017)	0,08 %	0,41 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)	(0,32 %)	(0,62 %)
Indice Bloomberg World Government inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en EUR)	0,32 %	0,30 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2017)	0,83 %	1,46 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 18 février 2014)	0,80 %	1,20 %
Indice Bloomberg World Government inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en GBP)	1,07 %	1,22 % ²
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 22 septembre 2022)	0,70 %	1,30 %
Indice Bloomberg World Government inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en SGD)	0,97 %	1,03 %

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, 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, 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 :

- » La sous-pondération des produits dérivés libellés en euros, en particulier les swaps de taux d'intérêt et les options, a contribué à la performance relative, car les taux de swap ont augmenté.
- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux américains a contribué à la performance relative, les rendements nominaux américains ayant augmenté.
- » L'exposition à des titres adossés à des créances hypothécaires (MBS) émis par des organismes gouvernementaux, en particulier les MBS résidentiels (RMBS), a contribué à la performance relative, car les écarts de ces titres se sont resserrés.
- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux japonais a nuí à la performance relative, car les rendements nominaux japonais ont baissé.
- » Le positionnement sur la courbe des taux d'intérêt souverains nominaux italiens, en particulier l'exposition sous-pondérée à la partie à 10 ans de la courbe, a nuí à la performance relative, car cette partie a chuté.
- » La surpondération du yen japonais, financée par une sous-pondération du dollar américain, a nuí à la performance relative, car le yen s'est déprécié par rapport au dollar américain.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 septembre 2003)	1,67 %	4,06 %
Institutions, distribution (lancement le 30 décembre 2005)	1,70 %	3,70 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 4 mars 2004)	1,44 %	3,53 %
Investisseurs, distribution (lancement le 24 février 2009)	1,51 %	3,95 %
Administrations, capitalisation (lancement le 17 décembre 2004)	1,42 %	3,27 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	1,19 %	2,92 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)	1,15 %	2,82 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 21 mai 2004)	1,58 %	3,86 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	1,52 %	1,76 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD)	1,72 %	3,85 % ²
Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)		
Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 1 ^{er} septembre 2017)	2,56 %	0,00 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (non couvert en USD)	2,59 %	(0,22 %)
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 16 mai 2008)	(0,53 %)	1,80 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)	(0,43 %)	0,04 %
Investisseurs en CHF (couverte), distribution (lancement le 24 février 2009)	(0,66 %)	2,23 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en CHF)	(0,53 %)	1,49 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2003)	0,39 %	3,07 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	0,41 %	2,61 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 7 avril 2004)	0,24 %	2,60 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(0,06 %)	1,86 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en EUR)	0,36 %	2,82 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 5 février 2004)	1,19 %	4,01 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 avril 2005)	1,11 %	3,57 %
Catégorie R en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	0,99 %	1,08 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en GBP)	1,13 %	3,83 % ²
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 29 février 2008)	1,01 %	3,10 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en SGD)	1,04 %	2,96 %

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, 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 :

- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux allemands a contribué à la performance relative, les rendements nominaux allemands ayant augmenté.
- » La sous-pondération des produits dérivés libellés en euros, en particulier les swaps de taux d'intérêt et les options, a contribué à la performance relative, car les taux de swap ont augmenté.
- » L'exposition à des titres adossés à des créances hypothécaires (MBS) émis par des organismes gouvernementaux, en particulier les MBS résidentiels (RMBS), a contribué à la performance relative, car les écarts de ces titres se sont resserrés.
- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux japonais a nui à la performance relative, car les rendements nominaux japonais ont baissé.
- » Le positionnement sur la courbe des taux d'intérêt souverains nominaux italiens, en particulier l'exposition sous-pondérée à la partie à 10 et 12 ans de la courbe, a nui à la performance relative, car cette partie a chuté.
- » La surpondération du yen japonais, financée par une sous-pondération du dollar américain, a nui à la performance relative, car le yen s'est déprécié par rapport au dollar.

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 net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	3,29 %	4,74 %
Institutions, distribution (lancement le 30 novembre 2012)	3,26 %	4,74 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 20 janvier 2015)	3,12 %	3,38 %
Investisseurs, distribution (lancement le 18 avril 2013)	3,17 %	3,56 %
Administrations, capitalisation (lancement le 13 février 2017)	2,99 %	2,52 %
Administrations, distribution (lancement le 30 novembre 2012)	2,96 %	4,22 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	2,84 %	3,81 %
Catégorie E, distribution (lancement le 30 novembre 2012)	2,85 %	3,80 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 25 mai 2018)	3,16 %	2,62 %
H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018)	3,16 %	2,62 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 7 novembre 2019)	3,14 %	1,37 %
Catégorie R, distribution (lancement le 30 avril 2015)	3,16 %	3,28 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	2,62 %	2,27 %
Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)	2,57 %	2,28 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	3,60 %	5,31 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	1,18 % ^a
Catégories libellées en AUD		
Institutions en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 17 janvier 2018)	2,36 %	1,49 %
Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)	2,14 %	1,45 %
Administrations en AUD (couverte), distribution (lancement le 8 juin 2016)	2,05 %	2,43 %
Catégorie E en AUD (couverte), distribution (lancement le 16 février 2017)	1,86 %	1,39 %
Catégorie Z en AUD (couverte), distribution II (lancement le 28 octobre 2015)	2,56 %	3,80 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD)	1,13 %	0,71 % ^a
Catégories libellées en BRL		
Institutions en BRL (couverte), capitalisation (lancement le 3 février 2016)	16,56 %	6,53 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en BRL)	6,33 %	7,24 %
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} avril 2016)	2,94 %	3,25 %
Institutions en CAD (couverte), distribution (lancement le 7 septembre 2018)	2,94 %	2,42 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CAD)	1,74 %	0,31 % ^a
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 décembre 2014)	1,08 %	1,35 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)	1,03 %	1,07 %
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)	0,56 %	0,74 %
Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 18 février 2014)	0,70 %	0,75 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF)	(0,16 %)	(0,88 %) ^a
Catégories libellées en CNH		
Investisseurs en RMB (couverte), capitalisation (lancement le 3 janvier 2018)	1,61 %	2,96 %
Catégorie E en RMB (couverte), distribution (lancement le 22 mai 2013)	1,34 %	4,60 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CNH)	0,46 %	3,23 % ^a
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	1,98 %	3,15 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	1,95 %	3,13 %
Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 29 juillet 2014)	1,89 %	1,77 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 avril 2015)	1,85 %	1,17 %
Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mai 2015)	1,77 %	1,22 %
Investisseurs en EUR (couverte), distribution A (lancement le 16 décembre 2015)	1,88 %	1,36 %

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 :

- » L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » et à rendement élevé a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition longue à certaines devises de marchés émergents a contribué à la performance, car ces devises se sont appréciées face au dollar américain.
- » La sélection de titres au sein de la dette locale des marchés émergents a contribué à la performance, le cours des titres sous-jacents s'étant apprécié.
- » L'exposition longue à la duration américaine a nuí à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.
- » L'exposition longue au yen japonais et à la couronne norvégienne a nuí à la performance, car ces devises se sont dépréciées par rapport au dollar américain.
- » L'exposition courte à la duration japonaise a nuí à la performance, car les taux d'intérêt japonais ont chuté.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹ (suite)

	6 mois	Lancement de la catégorie
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 août 2015)	1,68 %	1,12 %
Administrations en EUR (couverte), distribution (lancement le 8 juin 2016)	1,66 %	0,87 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	1,45 %	2,22 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	1,57 %	2,22 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution II (lancement le 31 août 2018)	1,56 %	(0,16 %)
Catégorie E en EUR (couverte), distribution II Q (lancement le 30 septembre 2019)	1,56 %	(1,00 %)
G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 août 2017)	1,55 %	(0,61 %)
Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2016)	1,85 %	1,48 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	1,36 %	0,45 %
Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014)	1,36 %	0,45 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)	0,74 %	(0,33 %) ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 7 février 2019)	2,80 %	1,40 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 février 2013)	2,73 %	3,23 %
Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2020)	2,60 %	(0,20 %)
Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 2 septembre 2016)	2,45 %	1,56 %
Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 mars 2017)	2,31 %	0,82 %
Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	2,65 %	3,71 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)	1,51 %	0,57 % ²
Catégories libellées en HKD		
Institutions en HKD (non couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)	3,70 %	3,79 %
Administrations en HKD (non couverte), distribution (lancement le 26 avril 2017)	3,41 %	2,43 %
Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 4 février 2013)	3,30 %	3,20 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD)	2,51 %	1,38 % ²
Catégories libellées en JPY		
Institutions en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 10 mars 2023)	—	0,80 %
Investisseurs en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 2 juin 2023)	—	0,40 %
Catégorie E en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} septembre 2017)	0,00 %	(0,70 %)
Catégorie E en JPY (couverte), distribution (lancement le 21 décembre 2022)	(0,01 %)	(0,81 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en JPY)	(0,90 %)	(1,98 %) ²
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 19 avril 2017)	2,17 %	1,62 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en NOK)	1,12 %	(0,28 %)
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 14 juillet 2020)	2,66 %	1,43 %
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 16 décembre 2015)	2,63 %	3,47 %
Investisseurs en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 7 février 2020)	2,44 %	0,24 %
Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)	2,48 %	2,00 %
Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	2,34 %	4,01 %
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 19 février 2013)	2,13 %	2,87 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD)	1,40 %	1,05 % 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 net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 29 janvier 2021)	2,99 %	(1,42 %)
Institutions, distribution (lancement le 3 mars 2023)	—	1,97 %
Catégorie E, distribution (lancement le 29 janvier 2021)	2,48 %	(2,31 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	(5,11 %) ²
Catégories libellées en AUD		
Catégorie E en AUD (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2021)	1,56 %	(3,23 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD)	1,13 %	(6,10 %)
Catégories libellées en EUR		
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 février 2021)	1,09 %	(4,19 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)	0,74 %	(6,77 %)
Catégories libellées en GBP		
Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 17 février 2021)	1,91 %	(3,01 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)	1,51 %	(5,70 %)
Catégories libellées en HKD		
Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2021)	2,84 %	(1,90 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD)	2,51 %	(4,69 %)

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

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 cherchera à maintenir un niveau élevé de revenu des dividendes en investissant dans un large éventail de secteurs à revenu fixe qui, selon l'opinion du Conseiller en investissement, produisent généralement des niveaux de revenu élevés.

Aperçu du Fonds

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

- » L'exposition longue à certaines devises de marchés émergents a contribué à la performance, car ces devises se sont appréciées face au dollar américain.
- » L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » et à rendement élevé a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition longue aux titres adossés à des créances hypothécaires commerciales et résidentielles européens a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition longue à la durée américaine a nuí à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.
- » L'exposition courte à la durée japonaise a nuí à la performance, car les taux d'intérêt japonais ont augmenté.
- » L'exposition longue au yen japonais a nuí à la performance, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.

Fonds Inflation Multi-Asset Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 14 février 2013)	0,54 %	1,09 %
Administrations, distribution II (lancement le 22 mars 2022)	0,32 %	(7,06 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 14 février 2013)	0,10 %	(0,09 %)
Catégorie E, distribution II (lancement le 2 août 2022)	0,08 %	(5,56 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022)	0,53 %	(5,00 %)
M Détail, distribution II (lancement le 2 août 2022)	0,05 %	(5,61 %)
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	0,81 %	1,05 % ²
Catégories libellées en AUD		
Catégorie E en AUD (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 18 août 2022)	(0,11 %)	(6,60 %)
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	0,36 %	(5,01 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2021)	(0,95 %)	(4,08 %)
Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2013)	(1,40 %)	(0,87 %)
Catégorie E en EUR (partiellement couverte), distribution (lancement le 16 avril 2013)	(1,41 %)	(0,87 %)
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	(0,95 %)	0,55 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 30 mai 2014)	(1,22 %)	1,42 %
Catégorie E en GBP (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 2 août 2022)	(1,59 %)	(7,40 %)
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	(1,20 %)	1,36 % ²
Catégories libellées en SGD		
Administrations en SGD (couverte), distribution II (lancement le 22 février 2022)	0,08 %	(4,98 %)
Catégorie E en SGD (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 2 août 2022)	(0,21 %)	(6,60 %)
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	0,38 %	(5,48 %) ²

Le Fonds Inflation Multi-Asset Fund (anciennement Fonds Inflation Strategy Fund) vise à préserver 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) mondiaux liés à l'inflation, 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'allocations 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 :

- » La sous-pondération tactique des matières premières a contribué à la performance relative, car les matières premières ont reculé.
- » Le positionnement sur la courbe dans le segment des produits dérivés libellés en euros, en particulier la sous-pondération des swaps de taux d'intérêt sur la partie à deux ans de la courbe des swaps, a contribué à la performance relative, car les taux des swaps ont augmenté sur cette partie de la courbe.
- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux allemands a contribué à la performance relative, les rendements nominaux allemands ayant augmenté.
- » La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux japonais a nuí à la performance relative, car les rendements nominaux japonais ont baissé.
- » La sélection de titres au sein des sociétés d'investissement immobilier a nuí à la performance relative.
- » La surpondération du yen japonais, financée par une sous-pondération du dollar américain, a nuí à la performance relative, car le yen s'est déprécié par rapport au dollar américain.

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).

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 5 décembre 2002)	0,83 %	2,23 %
Institutions, distribution (lancement le 5 décembre 2002)	0,83 %	2,22 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 13 mai 2004)	0,68 %	1,91 %
Investisseurs, distribution (lancement le 3 juillet 2003)	0,74 %	1,80 %
Administrations, capitalisation (lancement le 8 septembre 2004)	0,56 %	1,71 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 septembre 2007)	0,41 %	1,08 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)	0,40 %	1,38 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 4 novembre 2009)	0,77 %	1,23 %
H Institutions, distribution (lancement le 12 décembre 2018)	0,71 %	0,44 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	0,67 %	0,48 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	0,97 %	1,73 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 janvier 2012)	(0,31 %)	(0,28 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(0,37 %)	1,28 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 24 juillet 2009)	(0,76 %)	(0,41 %)
Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (couvert en EUR)	(0,23 %)	0,72 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2017)	0,41 %	(0,33 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1 ^{er} mars 2010)	0,37 %	0,88 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (couvert en GBP)	0,50 %	0,43 % 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 :

- » L'exposition à certaines participations détenues sous forme de crédit titrisé, en particulier les prêts garantis (CLO), a contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition longue au réal brésilien a contribué à la performance relative, car la devise s'est renforcée par rapport au dollar américain.
- » L'exposition sélective au crédit d'entreprises de qualité « investment grade », en particulier dans le secteur financier, a contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » La sous-pondération des indices de swaps de défaillance des entreprises de qualité « investment grade » a nuí à la performance relative, car les écarts sur obligations d'entreprises de qualité « investment grade » se sont resserrés.
- » La sous-pondération de la duration du Japon a nuí à la performance relative, car les taux d'intérêt ont chuté.
- » La surpondération des titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux a nuí à la performance relative, car les écarts se sont creusés dans le secteur.

Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 28 février 2014)	2,01 %	1,68 %
Institutions, distribution (lancement le 22 juin 2021)	1,95 %	(2,38 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en USD)	1,94 %	1,70 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014)	0,80 %	0,05 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 3 juin 2021)	0,84 %	(4,07 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014)	0,33 %	(0,85 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en EUR)	0,72 %	0,05 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014)	1,58 %	0,97 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 3 juin 2021)	1,52 %	(2,91 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en GBP)	1,47 %	0,98 % ²
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 10 juillet 2017)	1,06 %	0,28 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en NOK)	1,03 %	0,54 %

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 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 :

- » 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 dans le secteur des sociétés financières a contribué à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé le marché dans son ensemble.
- » La sous-pondération des titres d'entités liées à un gouvernement a contribué à la performance, en raison de la sous-performance du secteur.
- » Les stratégies macro, et en particulier le positionnement sur la courbe aux États-Unis, ont nui à la performance.
- » La sélection de titres dans le secteur de l'alimentation a nui à la performance, car un émetteur américain surpondéré a sous-performé.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 mai 2018)	3,67 %	2,42 %
Institutions, distribution (lancement le 31 mai 2018)	3,63 %	2,43 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mai 2018)	3,15 %	1,54 %
Catégorie E, distribution (lancement le 14 septembre 2018)	3,13 %	1,52 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 3 septembre 2020)	3,56 %	1,64 %
H Institutions, distribution (lancement le 18 janvier 2022)	3,55 %	(0,05 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	1,15 %	1,06 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018)	2,52 %	0,35 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 22 novembre 2021)	2,48 %	(1,82 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018)	1,99 %	(0,54 %)
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2018)	2,01 %	(0,53 %)
Catégorie Z en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 3 juin 2020)	2,74 %	1,57 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en EUR)	(0,06 %)	(0,94 %) ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018)	3,18 %	1,34 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2018)	3,26 %	1,35 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en GBP)	0,69 %	0,15 %
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2020)	3,06 %	1,57 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en SGD)	0,57 %	(1,28 %)

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 :

- » L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » et à rendement élevé a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition longue au crédit titrisé, principalement par le biais de titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles non émis par des organismes gouvernementaux d'Europe et des États-Unis, a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition longue à certaines devises de marchés émergents a contribué à la performance, car ces devises se sont appréciées face au dollar américain.
- » L'exposition courte à la durée japonaise a nui à la performance, car les taux d'intérêt japonais ont augmenté.
- » L'exposition longue à la durée américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.
- » L'exposition longue au yen japonais a nui à la performance, car le yen s'est déprécié par rapport au dollar américain.

Fonds Low Duration Opportunities Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 29 janvier 2016)	2,28 %	1,55 %
Institutions, distribution (lancement le 7 mars 2019)	2,25 %	0,41 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 septembre 2021)	2,60 %	(2,94 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ²	2,40 %	1,43 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016)	1,15 %	(0,42 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 4 avril 2018)	1,11 %	(1,16 %)
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 janvier 2018)	0,99 %	(1,57 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 octobre 2017)	0,79 %	(1,97 %)
Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ³	1,34 %	(0,16 %) ³
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016)	1,85 %	0,60 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2019)	1,77 %	(0,30 %)
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁴	2,06 %	0,77 % ⁴

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 (anciennement le Fonds Global Libor Plus 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 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 flexible 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 :

- » 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 brésiliens a contribué à la performance, car ces taux ont baissé.
- » L'exposition longue au réel brésilien a contribué à la performance, cette devise s'étant appréciée face au dollar américain.
- » 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 longue au crédit d'entreprises à rendement élevé a nui à la performance, ces titres ayant dégagé une performance négative.
- » L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.
- » 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 aux taux d'intérêt polonais a nui à la performance, car ces taux ont baissé.

Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	1,52 %	0,50 %
Institutions, distribution (lancement le 27 juillet 2022)	1,43 %	0,48 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	2,40 %	3,78 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	0,31 %	(1,90 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)	0,27 %	(1,89 %)
Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index	1,35 %	1,68 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	1,02 %	(0,50 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)	1,02 %	(0,53 %)
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	2,06 %	3,09 %

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 du 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 :

- » L'exposition longue au crédit de qualité « investment grade » a contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » Les participations détenues sous forme de titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux ont contribué à la performance, en particulier vers la fin du semestre, car les écarts se sont resserrés en mai et juin.
- » L'exposition longue à la duration en euro a contribué à la performance, en particulier le positionnement sur la courbe, car la courbe de taux européenne s'est davantage inversée.
- » L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.
- » L'exposition courte à l'euro a nui à la performance, car l'euro s'est apprécié par rapport au dollar américain.

Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 25 novembre 2014)	4,13 %	0,67 %
Institutions, distribution (lancement le 25 novembre 2014)	4,11 %	0,66 %
Catégorie E, distribution (lancement le 25 novembre 2014)	3,61 %	(0,51 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 7 juin 2019)	4,66 %	7,63 %
Indice Alerian MLP Index	9,70 %	(1,20 %) ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 novembre 2014)	2,77 %	(1,36 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 novembre 2014)	2,75 %	(1,35 %)
Indice Alerian MLP Index en EUR (couvert)	8,23 %	(2,91 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 novembre 2014)	3,65 %	(1,12 %)
Indice Alerian MLP Index en GBP (couvert)	8,97 %	(2,79 %)

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 à (i) 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 du secteur 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 :

- » L'exposition aux actions du secteur intermédiaire de l'énergie a contribué à la performance absolue, le secteur ayant généré une performance positive.
- » 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 sous-pondération des sociétés de marketing et de distribution a contribué à la performance relative, car le secteur a généré une performance négative.
- » 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.
- » La sous-pondération dans le sous-secteur du transport par pipeline du pétrole a nui à la performance relative, car le sous-secteur a surperformé et les participations détenues par le Fonds dans ce secteur ont sous-performé.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	2,23 %	1,47 %
Institutions, distribution (lancement le 25 janvier 2017)	2,35 %	1,49 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 12 mai 2017)	2,14 %	0,83 %
Investisseurs, distribution (lancement le 25 janvier 2017)	2,13 %	1,13 %
Administrations, distribution (lancement le 25 janvier 2017)	2,03 %	0,98 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	1,86 %	0,58 %
Catégorie E, distribution (lancement le 25 janvier 2017)	1,87 %	0,57 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 14 mai 2020)	2,22 %	0,35 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	2,40 %	1,73 % ²
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 1 ^{er} juin 2021)	2,05 %	(2,68 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en CAD) ³	2,13 %	1,74 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	0,21 %	(1,02 %)
Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 9 août 2017)	(0,12 %)	(2,42 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en CHF) ³	0,30 %	(0,79 %) ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	1,15 %	(0,54 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 janvier 2017)	1,11 %	(0,54 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	0,66 %	(1,44 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en EUR) ³	1,25 %	(0,27 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	1,88 %	0,48 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 25 janvier 2017)	1,92 %	0,47 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en GBP) ³	1,96 %	0,76 %

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 émises 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 :

- » 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.
- » L'exposition aux titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles senior non émises par des organismes gouvernementaux (RMBS) a contribué à la performance, car les écarts se sont resserrés.
- » L'exposition aux prêts garantis senior (CLO) 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 émises par des organismes gouvernementaux ont nui à la performance, car les écarts se sont légèrement creusés.
- » L'exposition aux taux d'intérêt américains a nui à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.
- » Les positions sur les titres adossés à des créances hypothécaires structurés émises par des organismes gouvernementaux (MBS), notamment sur les titres à intérêts uniquement (IO), ont nui à la performance, car le secteur a généré une performance relative.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 décembre 1998)	16,81 %	7,18 %
Institutions, distribution (lancement le 22 novembre 2001)	16,81 %	8,41 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 7 janvier 1999)	16,61 %	6,68 %
BE Détail, capitalisation (lancement le 28 avril 2022)	15,59 %	0,09 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006)	16,27 %	8,58 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 8 janvier 2020)	16,67 %	9,36 %
Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes)	16,60 %	6,78 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2012)	15,35 %	10,98 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 août 2017)	14,81 %	7,62 %
Indice S&P 500 Index (couvert en EUR) (net de la retenue à la source sur les dividendes)	14,97 %	10,64 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 17 juin 2021)	16,05 %	(0,10 %)
Indice S&P 500 Index (couvert en GBP) (net de la retenue à la source sur les dividendes)	15,69 %	2,04 %
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 22 avril 2022)	16,21 %	1,51 %
Indice S&P 500 Index (couvert en SGD) (rendement total net)	17,65 %	3,70 %

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. 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 :

» 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 16,60 %.

» La stratégie alpha obligatoire 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. Les participations ont été accrues et la valeur de ces obligations a par la suite augmenté.

» Les participations dans des titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux ont contribué à la performance, car la valeur de ces obligations a augmenté.

» L'exposition longue aux taux d'intérêt américains a nuï à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» L'exposition courte au crédit d'entreprises à rendement élevé a nuï à la performance, car les écarts se sont resserrés.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 29 mars 2019)	17,20 %	12,47 %
Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes)	16,60 %	12,51 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 17 juin 2021)	16,65 %	0,10 %
Indice S&P 500 Index (couvert en GBP) (net de la retenue à la source sur les dividendes)	15,69 %	2,04 %

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 « StockPLUS » (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 :

- » 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 16,60 %.
- » 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 la valeur de ces obligations a augmenté.
 - » Les participations dans des titres de prêts garantis ont contribué à la performance, car la valeur de ces obligations a augmenté.
 - » L'exposition longue aux taux d'intérêt américains a nui à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.
 - » L'exposition longue aux titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux a nui à la performance, car certaines obligations ont perdu de la valeur.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 14 mars 2018)	3,38 %	2,86 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 16 décembre 2013)	2,93 %	3,34 %
Catégorie E, distribution II (lancement le 16 décembre 2013)	2,91 %	3,33 %
75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index ²	2,53 %	3,55 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 décembre 2013)	2,19 %	2,86 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 décembre 2013)	1,87 %	1,92 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution II (lancement le 16 décembre 2013)	1,81 %	1,92 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	1,62 %	0,75 %
Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014)	1,67 %	0,77 %
75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en EUR) / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (couvert en EUR) ³	1,27 %	2,19 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 juillet 2022)	2,98 %	1,88 %
75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (couvert en GBP) / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (couvert en GBP) ³	2,05 %	(2,52 %)

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 :

Composante à revenu fixe

- » Les positions sur le crédit d'entreprises à rendement élevé ont contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » Les positions sur le crédit d'entreprises de qualité « investment grade » ont contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.
- » L'exposition longue aux obligations d'État locales russes a contribué à la performance, ces titres s'étant appréciés.
- » L'exposition longue au réal brésilien a contribué à la performance, cette devise s'étant appréciée face au dollar américain.
- » L'exposition courte à la duration japonaise a nuï à la performance, car les taux d'intérêt japonais ont chuté.
- » L'exposition longue à la duration américaine a nuï à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.
- » Les positions sur les titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux ont nuï à la performance absolue, ces titres s'étant dépréciés.
- » L'exposition longue au yen japonais a nuï à la performance, car la devise s'est dépréciée par rapport au dollar américain.

Composante actions

- » La sélection de titres dans le secteur des services financiers a contribué à la performance relative, les titres du Fonds ayant surperformé les titres de l'indice de référence dans ce secteur.
- » La sélection de titres dans le secteur de l'énergie a contribué à la performance relative, les titres du Fonds ayant surperformé les titres de l'indice de référence dans ce secteur.
- » La sous-pondération et la sélection de titres dans le secteur des services aux collectivités ont contribué à la performance relative, car le secteur a sous-performé l'indice de référence et les titres du Fonds ont surperformé les titres de l'indice de référence dans ce secteur.
- » La sélection de titres dans le secteur des biens de consommation de base a nuï à la performance relative, les titres du Fonds ayant sous-performé les titres de l'indice de référence dans ce secteur.
- » La surpondération et la sélection de titres au sein du secteur des soins de santé ont nuï à la performance relative, car le secteur a sous-performé l'indice de référence et les participations détenues par le Fonds ont sous-performé les participations de l'indice de référence dans ce secteur.
- » La sélection de titres dans le secteur industriel a nuï à la performance relative, les titres du Fonds ayant sous-performé les titres de l'indice de référence dans ce secteur.

Composante tactique

- » Il n'y a pas eu d'autres contributeurs importants pour ce Fonds.
- » L'exposition au secteur de l'immobilier a nuï à la performance, le secteur ayant enregistré une performance négative.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 1998)	2,15 %	4,35 %
Institutions, distribution (lancement le 25 avril 2000)	2,17 %	4,32 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 28 janvier 1999)	1,96 %	3,79 %
Investisseurs, distribution (lancement le 23 octobre 2000)	1,98 %	3,75 %
Administrations, capitalisation (lancement le 16 mai 2003)	1,91 %	2,88 %
Administrations, distribution (lancement le 21 juillet 2022)	1,90 %	(2,20 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	1,69 %	2,61 %
Catégorie E, distribution (lancement le 10 octobre 2005)	1,71 %	2,52 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002)	2,07 %	3,51 %
H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018)	2,09 %	0,38 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	1,53 %	(0,08 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	3,94 % ²
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), distribution (lancement le 2 mai 2013)	1,82 %	0,84 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CAD)	1,74 %	1,02 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 24 juin 2011)	0,00 %	(0,18 %)
Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 24 juin 2011)	(0,21 %)	(0,52 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 19 septembre 2012)	(0,48 %)	(1,71 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF)	(0,16 %)	(0,16 %) ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2003)	0,83 %	2,48 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	0,83 %	2,38 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2004)	0,66 %	1,99 %
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2009)	0,65 %	0,64 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	0,36 %	1,57 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mars 2012)	0,37 %	(0,82 %)
Catégorie R en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	0,65 %	(0,70 %)
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	0,23 %	(1,76 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)	0,74 %	2,06 % ²
Catégories libellées en EUR (non couvertes)		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 13 juin 2002)	(0,07 %)	2,98 %
Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 3 mars 2021)	(0,52 %)	(2,27 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en EUR)	(0,13 %)	2,65 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 26 mars 2010)	1,63 %	1,66 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	1,71 %	3,21 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)	1,51 %	2,82 % ²
Catégories libellées en HKD		
M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 20 février 2013)	2,14 %	0,31 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD)	2,51 %	1,39 %
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 11 janvier 2011)	1,48 %	1,71 %
Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 février 2023)	—	0,39 %
Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 15 février 2007)	1,02 %	2,08 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD)	1,40 %	2,61 % 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 :

- » La position tactique sur la duration américaine, notamment la surpondération de la partie intermédiaire de la courbe de taux, a contribué à la performance relative, les rendements ayant chuté au cours du premier trimestre 2023.
- » Les positions sur les titres adossés à des créances hypothécaires (« MBS ») non émis par des organismes gouvernementaux et sur d'autres actifs titrisés ont contribué à la performance relative, en particulier au deuxième trimestre, car les écarts se sont resserrés.
- » La sélection au sein du crédit d'entreprises de qualité « investment grade », en particulier la préférence pour le secteur financier, a contribué à la performance relative, les écarts s'étant resserrés au cours du deuxième trimestre 2023.
- » Les stratégies de taux d'intérêt dans la zone euro, en particulier l'orientation vers la pentification de la courbe des taux, ont nui à la performance relative, la courbe s'étant aplatie.
- » L'exposition courte à la duration au Japon a nui à la performance relative, les rendements ayant chuté.

Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2015)	(1,88 %)	2,87 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 23 septembre 2022)	(2,12 %)	(7,70 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 juin 2015)	(2,46 %)	1,75 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022)	(1,97 %)	(0,70 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 décembre 2021)	(1,25 %)	6,64 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	2,40 %	1,51 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2015)	(2,92 %)	1,15 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2022)	(3,09 %)	(9,00 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2015)	(3,46 %)	0,05 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en EUR) ³	1,25 %	(0,18 %) ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2022)	(2,23 %)	(3,40 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 23 septembre 2022)	(2,27 %)	(7,94 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en GBP) ³	1,96 %	2,63 % 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), d'instruments de crédit, d'indices d'actions et d'instruments liés à la volatilité (y compris, sans s'y limiter, des contrats à terme standardisés sur indices liés à la volatilité) et d'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 :

- » Les positions sur les taux canadiens, chiliens et hongrois ont nui à la performance, en raison de renversements de prix.
- » Les positions sur le baht thaïlandais, la roupie indienne et la roupie indonésienne ont nui à la performance, en raison de renversements de prix.
- » Les positions longues sur le peso mexicain et le peso colombien ont contribué à la performance, car ces devises se sont appréciées par rapport au dollar américain. La position courte sur le yuan chinois a contribué à la performance, car la devise s'est affaiblie par rapport au dollar américain.
- » Les positions longues sur les indices boursiers japonais, européens et américains ont contribué à la performance en raison de l'augmentation des prix.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Catégories libellées en GBP	6 mois	Lancement de la catégorie
Institutions, capitalisation (lancement le 28 septembre 2007)	(1,47 %)	3,82 %
Institutions, distribution (lancement le 8 juillet 2016)	(1,44 %)	(0,54 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 20 novembre 2019)	(1,29 %)	(4,62 %)
Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	(1,06 %)	3,60 % 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 :

- » La sélection de titres dans le secteur de la vente au détail a contribué à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé suite à l'amélioration de la rentabilité.
- » La sélection de titres au sein des sociétés d'investissement immobilier a contribué à la performance, car un émetteur sous-pondéré a sous-performé le marché dans son ensemble sur fond d'inquiétudes quant à l'impact de la hausse des taux d'intérêt et du resserrement des conditions financières.
- » Les stratégies macro, et particulièrement la surpondération de la duration britannique, ont nui à la performance, les taux d'intérêt ayant enregistré une baisse massive dans un contexte d'inflation plus élevée que prévu et de hausse des taux directeurs.
- » La sélection de titres dans les secteurs bancaire et du courtage a nui à la performance, l'exposition à la dette subordonnée, et en particulier celle d'une banque suisse, ayant sous-performé.
- » La surpondération du secteur des services aux collectivités a nui à la performance, car le secteur a sous-performé.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

Catégories libellées en GBP	6 mois	Lancement de la catégorie
Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005)	(3,05 %)	3,64 %
Institutions, distribution (lancement le 14 août 2008)	(3,02 %)	4,54 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index ³	(1,62 %)	3,29 % 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 :

- » La sous-pondération des actifs titrisés, qui ont sous-performé, a contribué à la performance.
- » La sélection de titres dans le secteur de la vente au détail a contribué à la performance, un émetteur surpondéré ayant surperformé suite à l'annonce d'économies de coûts visant à renforcer la rentabilité.
- » La sélection de titres dans les secteurs bancaire et du courtage a nui à la performance, l'exposition à la dette subordonnée, et en particulier celle d'une banque suisse, ayant sous-performé.
- » Les stratégies macro, et particulièrement la surpondération de la duration britannique, ont nui à la performance, les taux d'intérêt ayant enregistré une baisse massive dans un contexte d'inflation plus élevée que prévu et de relèvement répété des taux d'intérêt.
- » La sélection des titres dans le secteur immobilier a nui à la performance, car l'exposition à certaines sociétés d'investissement immobilier a sous-performé dans un contexte de pression sur les valeurs des actifs et de mesures de notation négatives.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 28 mai 1998)	5,36 %	5,43 %
Institutions, distribution (lancement le 23 janvier 2001)	5,28 %	5,74 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 mars 1999)	5,16 %	5,08 %
Investisseurs, distribution (lancement le 14 janvier 1999)	5,20 %	5,06 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	4,87 %	4,16 %
Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006)	4,90 %	4,24 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002)	5,26 %	6,45 %
H Institutions, distribution (lancement le 14 février 2020)	5,35 %	0,07 %
M Détail, distribution (lancement le 11 janvier 2012)	4,89 %	3,83 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	5,23 %	3,84 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 29 juin 2016)	5,58 %	4,52 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index ²	5,42 %	5,64 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 avril 2003)	4,03 %	4,77 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	4,01 %	4,00 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 février 2003)	3,86 %	4,69 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	3,54 %	3,01 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (couvert en EUR) ³	4,02 %	5,44 % ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2003)	4,81 %	5,38 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 juin 2016)	4,82 %	2,59 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (couvert en GBP) ³	4,78 %	5,86 % 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 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 :

- » La sélection des titres dans le secteur des jeux et de l'hébergement a contribué à la performance, car le secteur, ainsi que certains émetteurs surpondérés ont surperformé le marché dans son ensemble, dans un contexte de forte demande des consommateurs pour les services de loisirs et de divertissement.
- » La sélection de titres dans le secteur des services d'aide a contribué à la performance, car certains émetteurs surpondérés ont surperformé.
- » 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 médias, du divertissement et de l'édition a nui à la performance, car certains émetteurs surpondérés ont sous-performé.
- » La sous-pondération et la sélection de titres dans le secteur de la vente au détail ont nui à la performance, car le secteur a surperformé le marché dans son ensemble, tandis qu'un émetteur surpondéré a sous-performé.

Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 15 septembre 2016)	3,89 %	1,36 %
Institutions, distribution (lancement le 15 septembre 2016)	3,96 %	1,36 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 7 novembre 2019)	3,44 %	(2,79 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 8 mars 2019)	3,46 %	(0,45 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022)	3,81 %	0,90 %
Indice Bloomberg U.S. Credit Index	3,13 %	1,35 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 septembre 2016)	2,60 %	(0,81 %)
Indice Bloomberg U.S. Credit Index (couvert en EUR)	1,70 %	(0,86 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution II (lancement le 15 septembre 2016)	3,35 %	0,13 %
Indice Bloomberg U.S. Credit Index (couvert en GBP)	2,49 %	0,16 %

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 :

- » La sélection de titres dans les secteurs bancaire et du courtage a contribué à la performance, car la surpondération de la dette senior d'un émetteur européen a surperformé suite à son acquisition par un concurrent mieux noté.
- » Les stratégies macro, et en particulier la position sur la durée américaine et l'exposition aux taux d'intérêt locaux des marchés émergents, ont contribué à la performance.
- » La sélection de titres au sein du secteur des services aux collectivités a contribué à la performance, car un émetteur surpondéré a surperformé.
- » La surpondération et la sélection de titres au sein du secteur des autres valeurs financières ont nui à la performance, car un prêteur américain spécialisé surpondéré a sous-performé dans un contexte de faiblesse généralisée du secteur financier américain.
- » L'exposition aux produits titrisés a nui à la performance, car certains titres adossés à des créances hypothécaires commerciales ou adossés à des actifs ont sous-performé.

Rendement net total après commissions et frais pour la période close le 30 juin 2023¹

	6 mois	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2014)	2,55 %	1,71 %
Institutions, distribution (lancement le 11 mai 2020)	2,65 %	1,44 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 30 juin 2014)	2,36 %	1,36 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 juin 2014)	2,37 %	1,32 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018)	2,50 %	1,46 %
Catégorie Z, distribution (lancement le 7 août 2014)	2,77 %	2,18 %
Indice FTSE 3-Month Treasury Bill Index	2,39 %	1,08 % ²
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016)	1,51 %	0,08 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 juin 2016)	1,26 %	(0,47 %)
Indice ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (couvert en EUR)	1,10 %	(0,60 %) ²
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2023)	—	0,50 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (couvert en GBP)	1,81 %	0,38 %

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 :

- » La surpondération du crédit d'entreprises de qualité « investment grade », en particulier dans les secteurs de la finance et de l'industrie, a contribué à la performance relative, car les écarts du segment du crédit d'entreprises se sont resserrés.
- » La sous-pondération de la durée des États-Unis a contribué à la performance relative, car les taux d'intérêt ont augmenté.
- » La surpondération des prêts garantis (CLO) a contribué à la performance relative, car les écarts se sont resserrés.
- » La sous-pondération des indices de swaps de défaillance des entreprises de qualité « investment grade » a nui à la performance relative, car les écarts sur obligations d'entreprises de qualité « investment grade » se sont resserrés.
- » La sélection des titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux a nui à la performance relative en raison du resserrement des écarts.

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 BofAML 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 BofAML 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 JP Morgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified réplique la performance totale des instruments de créance libellés en USD 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 Merrill Lynch 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 Merrill Lynch 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 1-30 Year Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert), 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 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 la performance 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 / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD)	L'Indice de référence est une combinaison de 50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index / 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 Global Aggregate (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 Global Aggregate Index (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 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.

Nom officiel des indices de référence	Description des indices
75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index	L'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index se base sur l'Indice MSCI ACWI (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. L'Indice Bloomberg US Aggregate Index (couvert en EUR) représente des titres enregistrés auprès de la SEC imposables et libellés en dollar. 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 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 euros 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 titres à taux fixe assortis 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 titres des émetteurs en dehors de la zone euro sont inclus s'ils 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 titres à taux fixe assortis 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 titres des émetteurs en dehors de la zone euro sont inclus s'ils 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 euros 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 titres à taux fixe assortis 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 titres des émetteurs en dehors de la zone euro sont inclus s'ils 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 Index 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 » d'une durée 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. 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 Year Index représente des titres enregistrés auprès de la SEC, imposables et libellés en dollar 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 dollars canadiens des garanties en utilisant les bons du Trésor et les obligations du gouvernement du Canada comme garantie des opérations de pension.
Indice Euro Short-Term Rate (ESTER) Index	Le taux ESTER reflète les coûts d'emprunt au jour le jour non garantis en euros de gros des banques situées dans la zone euro. Le taux ESTER est publié chaque jour où le système de paiement transeuropéen automatisé en temps réel de virement express à règlement brut (ou tout système de règlement qui lui succède) est ouvert pour le règlement des paiements en euros. Le taux ESTER est basé sur les transactions réalisées et réglées le jour ouvrable précédent (la date de déclaration « T ») avec une date d'échéance de T+1 qui sont réputées avoir été exécutées selon le principe de pleine concurrence et reflètent ainsi objectivement les taux du marché.
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 Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch 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 Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (couvert en EUR)	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch 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 de 6 mois plus ancien.

Nom officiel des indices de référence	Description des indices
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	L'Indice est conçu pour suivre la performance de titres de créance d'entreprises de qualité inférieure à « investment grade » libellés en euros et en livres sterling émis publiquement sur les marchés des euro-obligations, et les marchés nationaux en livres sterling ou en euros. 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 %. De plus amples informations sur l'Indice, y compris une description à jour de sa duration, sont disponibles sur demande auprès du Conseiller en investissement.
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch 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.
Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch 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 Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch 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 Merrill Lynch U.S. High Yield Constrained Index	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch US 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 USD 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 du marché monétaire 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 instruments de créance libellés en USD 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 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 GBI-EM 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 JACI Composite Total Return (couvert en EUR)	L'Indice JP Morgan Asia Credit Index (couvert en EUR) mesure la performance des marchés d'obligations libellées en USD de l'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 JACI Non-Investment Grade	L'Indice JPMorgan JACI Non-IG 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 JACI Non-IG Index 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 boursier 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 SGD au jour le jour sans garantie à Singapour.

(Cette page est laissée vierge volontairement)

Bilan

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	\$ 2 458 996	\$ 2 652 171	\$ 281 696	\$ 276 959
Fonds d'investissement	271 904	239 979	20 835	29 746
Contrats de mise en pension	7 016	20 572	347	820
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	32 729	54 267	3 452	3 700
Liquidités	2 118	0	511	546
Dépôts auprès de contreparties	23 599	34 314	2 463	2 017
Produits à recevoir	47 232	48 231	4 467	3 836
À recevoir sur investissements vendus	0	18 600	9 689	0
À recevoir sur investissements vendus TBA	0	0	0	0
À recevoir sur Actions du Fonds vendues	38	5 111	71	119
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	19 571	14 965	2 203	1 946
Autres actifs	0	0	0	0
Total des actifs à court terme	2 863 203	3 088 210	325 734	319 689
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(15 108)	(27 401)	(1 473)	(1 065)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(9 208)	(3 578)	(500)	0
À payer sur investissements achetés TBA	0	0	0	0
À payer sur Actions du Fonds rachetées	(5 497)	(11 061)	(89)	(76)
Frais de gestion à payer	(1 533)	(1 671)	(168)	(164)
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	(31)	(41)	0	0
Découvert bancaire	0	(13 527)	0	0
Dividendes à payer	(186)	(161)	(1)	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(26 849)	(25 632)	(1 658)	(1 842)
Dépôts des contreparties	(8 620)	(23 746)	(2 026)	(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	(67 032)	(106 818)	(5 915)	(5 702)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	\$ 2 796 171	\$ 2 981 392	\$ 319 819	\$ 313 987

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

Fonds PIMCO Capital Securities Fund		Fonds PIMCO Climate Bond Fund		Fonds Commodity Real Return Fund		Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
\$ 5 571 381	\$ 6 129 600	\$ 249 473	\$ 248 281	\$ 1 389 961	\$ 1 750 918	\$ 90 030	\$ 80 195
142	140	0	0	123	120	9 730	9 649
25 100	10 172	34 000	36 800	2 394	59 113	13 153	6 910
0	0	0	0	0	0	0	0
76 310	107 561	7 671	8 236	30 742	45 313	2 113	2 563
753	2 624	1 803	1 484	3 138	4 491	181	177
74 364	110 882	3 962	8 041	50 334	39 055	1 687	1 533
52 834	66 969	2 397	2 192	4 373	4 250	877	1 002
10 122	33 701	0	0	251	50 448	6	206
0	0	0	0	89 717	206 413	17 215	1 296
1 327	3 060	111	363	722	5 062	37	138
29 148	54 526	2 233	1 167	5 966	17 822	254	1 075
0	0	0	0	0	0	0	0
5 841 481	6 519 235	301 650	306 564	1 577 721	2 183 005	135 283	104 744
(86 968)	(86 485)	(3 233)	(5 599)	(50 389)	(50 044)	(1 132)	(2 137)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2 600)	(1)	(544)	0	0	0	(300)	(304)
0	0	0	0	(179 499)	(288 321)	(32 545)	(3 587)
(2 370)	(7 922)	(2 263)	(193)	(4 480)	(3 460)	(51)	(50)
(4 402)	(4 729)	(138)	(145)	(870)	(1 261)	(87)	(89)
(253 383)	(578 475)	0	0	(339 254)	(425 302)	0	0
0	0	0	0	(23 081)	(17 959)	0	0
(203)	(237)	(7)	(24)	(9)	(15)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1 217)	(906)	(372)	(157)	(285)	(336)	0	0
(16 273)	(77 568)	(179)	(3 321)	(4 962)	(18 239)	(1 062)	(833)
(24 063)	(41 321)	(5 390)	(4 470)	(1 726)	(8 191)	(310)	(591)
0	0	0	0	0	0	0	0
(391 479)	(797 644)	(12 126)	(13 909)	(604 555)	(813 128)	(35 487)	(7 591)
\$ 5 450 002	\$ 5 721 591	\$ 289 524	\$ 292 655	\$ 973 166	\$ 1 369 877	\$ 99 796	\$ 97 153

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Diversified Income Fund		Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	\$ 6 106 201	\$ 6 620 617	\$ 359 563	\$ 401 584
Fonds d'investissement	795 982	876 630	51 387	55 806
Contrats de mise en pension	1 236 637	1 746 323	107 366	102 832
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	152 168	132 621	31 613	19 178
Liquidités	2 539	0	65	513
Dépôts auprès de contreparties	212 801	282 594	28 166	20 323
Produits à recevoir	82 191	83 844	4 825	5 122
À recevoir sur investissements vendus	36 373	51 445	1 251	1 998
À recevoir sur investissements vendus TBA	403 838	248 272	23 627	19 854
À recevoir sur Actions du Fonds vendues	6 266	5 685	39	98
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	95 166	113 759	21 012	19 031
Autres actifs	0	0	0	0
Total des actifs à court terme	9 130 162	10 161 790	628 914	646 339
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(151 381)	(150 759)	(8 987)	(5 030)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(8 728)	(586 220)	0	(940)
À payer sur investissements achetés TBA	(868 173)	(549 539)	(53 598)	(39 365)
À payer sur Actions du Fonds rachetées	(5 225)	(7 240)	(205)	(2 623)
Frais de gestion à payer	(6 860)	(8 022)	(381)	(438)
À payer sur contrats de prise en pension	(63 195)	(6 646)	(368)	0
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	(148)	(148)	(1)	(2)
Découvert bancaire	0	(3 465)	0	0
Dividendes à payer	(5 802)	(3 841)	(1 408)	(870)
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(34 281)	(62 209)	(35 405)	(29 190)
Dépôts des contreparties	(43 652)	(31 905)	(6 994)	(3 197)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(1 187 445)	(1 409 994)	(107 347)	(81 655)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	\$ 7 942 717	\$ 8 751 796	\$ 521 567	\$ 564 684

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

Fonds Diversified Income ESG Fund		Fonds Dynamic Bond Fund		Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		Fonds Emerging Local Bond Fund	
Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
\$ 44 287	\$ 9 978	\$ 3 011 520	\$ 2 712 201	€ 4 246 875	€ 4 130 924	\$ 2 549 023	\$ 1 772 984
5 064	0	336 750	348 722	419 861	504 414	269 736	131 643
7 400	0	555 858	1 145 692	329 566	124 604	0	0
0	0	0	0	0	0	19 027	7 054
1 079	60	144 276	74 933	117 828	234 476	139 995	315 328
509	108	6 281	7 730	13 209	38 251	38 890	35 990
695	113	71 278	96 997	169 395	395 426	46 277	51 091
610	112	17 860	16 752	18 832	5 003	50 874	35 522
0	0	12 924	7 837	1 663	9 331	1 618	26 063
197	603	689 297	454 635	592 089	0	0	0
0	0	1 939	2 056	1 137	2 321	3 236	4 086
37	27	51 889	69 677	88 263	165 342	41 366	102 125
0	0	0	0	0	0	0	17
59 878	11 001	4 899 872	4 937 232	5 998 718	5 610 092	3 160 042	2 481 903
(1 391)	(73)	(121 129)	(160 788)	(98 515)	(236 948)	(125 287)	(313 285)
0	0	(82 313)	(82 152)	0	0	0	0
0	0	(1 263)	(557 164)	0	(21 731)	(26 546)	(28 070)
(396)	(1 000)	(1 246 477)	(607 223)	(1 520 012)	0	0	0
(43)	0	(1 993)	(600)	(12 243)	(13 813)	(399)	(665)
(34)	(6)	(2 661)	(2 772)	(4 392)	(5 575)	(2 131)	(1 496)
0	0	(217)	(2 164)	0	(17 828)	(150 013)	(85 313)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	0	(64)	(68)	(30)	(33)	(611)	(206)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(1 234)	(680)	(319)	0	0	0
(14)	(68)	(14 522)	(28 530)	(47 082)	(115 772)	(23 381)	(83 123)
(10)	0	(60 706)	(11 490)	(57 914)	(83 222)	(46 231)	(50 077)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1 889)	(1 147)	(1 532 579)	(1 453 631)	(1 740 507)	(494 922)	(374 599)	(562 235)
\$ 57 989	\$ 9 854	\$ 3 367 293	\$ 3 483 601	€ 4 258 211	€ 5 115 170	\$ 2 785 443	\$ 1 919 668

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Emerging Local Bond ESG Fund		Fonds Emerging Markets Bond Fund	
	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	\$ 7 580	\$ 6 270	\$ 3 348 247	\$ 3 267 661
Fonds d'investissement	0	0	30 285	52 797
Contrats de mise en pension	0	0	0	9 160
Dépôts auprès d'établissements de crédit	54	4	24 740	2 227
Instruments financiers dérivés	229	269	76 871	69 071
Liquidités	143	127	6 357	4 943
Dépôts auprès de contreparties	60	39	22 310	49 025
Produits à recevoir	135	122	59 573	52 462
À recevoir sur investissements vendus	0	0	9 003	400
À recevoir sur investissements vendus TBA	0	0	34 093	26 106
À recevoir sur Actions du Fonds vendues	0	0	4 214	714
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	30	11	16 555	25 590
Autres actifs	0	0	0	0
Total des actifs à court terme	8 231	6 842	3 632 248	3 560 156
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(210)	(215)	(48 881)	(49 305)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(126)	0	(37 127)	(10 331)
À payer sur investissements achetés TBA	0	0	(58 022)	(49 405)
À payer sur Actions du Fonds rachetées	0	0	(4 783)	(13 371)
Frais de gestion à payer	(4)	(4)	(2 440)	(2 521)
À payer sur contrats de prise en pension	(110)	0	(54 912)	(75 356)
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	(10)	(2)	(15)	(12)
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	0	0	(280)	(276)
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(19)	(12)	(4 716)	(15 372)
Dépôts des contreparties	(60)	0	(31 425)	(38 228)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(539)	(233)	(242 601)	(254 177)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	\$ 7 692	\$ 6 609	\$ 3 389 647	\$ 3 305 979

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

Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund		Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	
Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
\$ 2 242 384	\$ 2 422 256	\$ 138 695	\$ 143 387	\$ 205 639	\$ 181 600	\$ 17 353	\$ 15 264
0	0	15 721	16 518	12 618	14 797	1 960	2 058
90 940	44 661	3 949	8 386	939	706	150	2 766
17 905	1 659	1 140	0	1 619	137	153	78
61 429	56 599	3 855	4 439	31 819	34 841	1 329	4 060
1 589	2 605	231	262	190	1 447	94	185
20 189	25 425	1 722	1 839	9 662	10 495	273	282
33 927	37 299	1 933	1 915	2 286	1 549	126	87
37 854	215	466	1	19 074	207	5	1
3 487	4 814	2 559	1 285	0	0	0	0
10 806	10 705	0	55	3	0	10	11
9 457	10 516	1 704	984	7 351	5 129	106	254
0	0	0	0	0	0	0	0
2 529 967	2 616 754	171 975	179 071	291 200	250 908	21 559	25 046
(33 210)	(23 713)	(1 644)	(618)	(24 089)	(31 528)	(946)	(3 067)
(551)	0	0	0	0	0	0	0
(49 523)	(3 745)	(1 192)	(2 163)	(19 808)	0	0	(109)
(6 478)	(7 710)	(5 626)	(2 563)	0	0	0	0
(2 617)	(461)	(60)	(10)	(15)	(586)	(11)	(5)
(1 746)	(1 929)	(161)	(172)	(85)	(64)	(23)	(25)
(36 961)	(38 840)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	(1)	0	0	0	(8)	0	(1)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1 780)	(2 167)	0	0	0	0	0	0
(5 266)	(9 012)	(1 696)	(1 872)	(11 195)	(10 037)	(225)	(631)
(29 501)	(36 701)	(1 863)	(2 687)	(5 440)	(3 554)	(271)	(271)
0	0	0	0	0	0	0	0
(167 634)	(124 279)	(12 242)	(10 085)	(60 632)	(45 777)	(1 476)	(4 109)
\$ 2 362 333	\$ 2 492 475	\$ 159 733	\$ 168 986	\$ 230 568	\$ 205 131	\$ 20 083	\$ 20 937

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO ESG Income Fund		Fonds Euro Bond Fund	
	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	\$ 316 722	\$ 254 108	€ 1 600 490	€ 1 747 790
Fonds d'investissement	0	0	132 603	181 654
Contrats de mise en pension	31 800	44 400	104 244	11 515
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	6 458	5 555	34 165	49 805
Liquidités	850	1 533	4 760	3 052
Dépôts auprès de contreparties	4 337	2 737	51 066	59 589
Produits à recevoir	1 664	1 372	8 624	8 903
À recevoir sur investissements vendus	349	80	2 764	13 467
À recevoir sur investissements vendus TBA	80 076	78 252	201 972	168 280
À recevoir sur Actions du Fonds vendues	676	221	208	932
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	4 896	4 814	21 575	105 486
Autres actifs	0	0	0	0
Total des actifs à court terme	447 828	393 072	2 162 471	2 350 473
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(6 257)	(4 277)	(34 899)	(122 819)
Juste valeur des titres vendus à découvert	(441)	(2 630)	0	0
À payer sur investissements achetés	(22 288)	(707)	0	(95)
À payer sur investissements achetés TBA	(157 506)	(141 114)	(344 659)	(264 938)
À payer sur Actions du Fonds rachetées	(101)	(12)	(648)	(405)
Frais de gestion à payer	(134)	(118)	(768)	(807)
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	(10)	(12)	(5)	(5)
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	(1)	(1)	0	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(2 431)	(3 190)	(12 388)	(41 188)
Dépôts des contreparties	(3 967)	(3 050)	(15 543)	(6 941)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(193 136)	(155 111)	(408 910)	(437 198)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	\$ 254 692	\$ 237 961	€ 1 753 561	€ 1 913 275

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

Fonds Euro Credit Fund		Fonds Euro Income Bond Fund		Fonds Euro Long Average Duration Fund		Fonds Euro Short-Term Fund	
Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
€ 528 695	€ 491 678	€ 1 389 763	€ 1 100 441	€ 441 943	€ 103 959	€ 199 083	€ 330 698
51 452	50 689	124 045	134 815	11 160	4 940	0	0
28 577	44 621	122 674	120 458	7 333	1 500	9 531	14 100
0	0	0	0	0	0	0	0
8 106	9 083	33 023	26 003	1 386	3 789	3 282	5 409
3 510	12 028	10 479	7 361	278	397	395	896
10 762	26 366	48 778	47 460	6 017	4 382	4 613	6 396
4 409	4 187	7 767	8 869	3 284	1 039	862	1 735
6 412	2 447	5 106	53 521	0	0	0	63
19 416	1 073	550 730	117 074	10 758	6 332	0	0
174	242	3 708	1 107	155 112	51	35	550
6 051	33 489	18 857	19 325	1 238	16 625	407	5 754
0	0	0	0	0	0	0	0
667 564	675 903	2 314 930	1 636 434	638 509	143 014	218 208	365 601
(3 786)	(13 081)	(29 615)	(27 457)	(1 023)	(18 830)	(1 162)	(2 312)
0	0	0	0	0	0	0	0
(11 362)	(7 404)	(3 667)	(22 578)	(138 012)	0	0	0
(31 466)	(13 488)	(984 881)	(208 728)	(47 356)	(11 721)	0	0
(30)	(85)	(1 480)	(1 033)	(129)	0	(1 223)	(1 514)
(233)	(252)	(1 149)	(1 244)	(49)	(46)	(61)	(105)
(549)	0	(8 856)	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(17)	(17)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(9 188)	(29 619)	(9 312)	(18 036)	(1 975)	(2 369)	(1 463)	(6 452)
(1 011)	(1 966)	(13 783)	(4 361)	0	0	(940)	(2 123)
0	0	0	0	0	0	0	0
(57 625)	(65 895)	(1 052 760)	(283 454)	(188 544)	(32 966)	(4 849)	(12 506)
€ 609 939	€ 610 008	€ 1 262 170	€ 1 352 980	€ 449 965	€ 110 048	€ 213 359	€ 353 095

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund		Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	
	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	€ 203 864	€ 157 222	€ 145 291	€ 193 346
Fonds d'investissement	11 682	8 700	11 875	18 800
Contrats de mise en pension	3 200	3 700	295	4 400
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	2 412	2 007	1 608	7 774
Liquidités	1 561	3 440	224	640
Dépôts auprès de contreparties	4 006	2 986	2 542	4 772
Produits à recevoir	2 358	1 897	954	1 077
À recevoir sur investissements vendus	1	32	2 489	1 622
À recevoir sur investissements vendus TBA	0	0	13 480	12 293
À recevoir sur Actions du Fonds vendues	137	71	132	293
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	1 253	1 485	3 078	4 861
Autres actifs	0	0	0	0
Total des actifs à court terme	230 474	181 540	181 968	249 878
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(1 400)	(1 105)	(4 435)	(8 310)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(888)	(4 181)	(613)	(590)
À payer sur investissements achetés TBA	0	0	(27 026)	(23 393)
À payer sur Actions du Fonds rachetées	(77)	(1)	(467)	(111)
Frais de gestion à payer	(49)	(13)	(51)	(66)
À payer sur contrats de prise en pension	(837)	0	0	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	(2 280)	(2 078)	(671)	(5 044)
Dépôts des contreparties	(270)	0	(827)	(1 192)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(5 801)	(7 378)	(34 090)	(38 706)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	€ 224 673	€ 174 162	€ 147 878	€ 211 172

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

Fonds Global Advantage Fund		Fonds Global Bond Fund		Fonds Global Bond ESG Fund		Fonds Global Bond Ex-US Fund	
Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
\$ 518 780	\$ 443 632	\$ 14 608 940	\$ 11 361 097	\$ 3 663 093	\$ 2 913 880	\$ 880 157	\$ 737 412
21 489	18 242	1 249 595	1 120 979	0	5 649	50 080	47 322
2 347	1 408	721 100	1 346 970	206 285	1 157 847	1 874	1 625
0	0	0	0	0	0	0	0
21 498	25 927	664 136	518 391	179 715	94 009	48 176	35 105
3 640	3 907	40 094	32 207	11 702	8 552	6 153	5 507
17 835	15 524	391 910	478 539	81 892	125 721	27 630	39 796
2 996	2 702	54 450	51 007	14 180	10 094	3 825	3 559
8 571	9 551	296 314	279 220	31 129	26 307	16 485	15 805
187 611	96 161	5 312 529	4 755 367	694 836	450 850	338 294	255 052
1	3	57 121	77 660	10 249	3 518	900	460
13 448	22 907	326 798	658 178	88 034	164 909	26 115	56 123
0	0	0	0	0	0	0	0
798 216	639 964	23 722 987	20 679 615	4 981 115	4 961 336	1 399 689	1 197 766
(23 470)	(21 316)	(570 797)	(859 558)	(88 084)	(151 501)	(36 366)	(63 177)
(28 873)	(28 813)	(722 957)	(721 316)	(124 257)	(119 122)	(78 766)	(76 200)
(8 453)	(8 457)	(297 938)	(930 760)	(42 977)	(622 586)	(15 636)	(15 641)
(310 625)	(140 479)	(9 067 703)	(6 231 107)	(1 205 227)	(792 022)	(497 245)	(282 153)
(6)	(35)	(22 823)	(13 836)	(3 872)	(10 843)	(385)	(75)
(241)	(250)	(6 072)	(5 736)	(1 366)	(1 314)	(330)	(342)
0	(1 504)	(1 895)	(1 682)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(26)	(17)	(173)	(137)	(3)	(3)	(6)	(7)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(922)	(736)	(1 740)	(399)	0	0
(11 607)	(23 802)	(168 589)	(407 767)	(68 428)	(125 388)	(24 910)	(41 421)
(3 300)	(4 832)	(251 408)	(86 868)	(100 327)	(31 968)	(15 469)	(2 728)
0	0	0	0	0	0	0	0
(386 601)	(229 505)	(11 111 277)	(9 259 503)	(1 636 281)	(1 855 146)	(669 113)	(481 744)
\$ 411 615	\$ 410 459	\$ 12 611 710	\$ 11 420 112	\$ 3 344 834	\$ 3 106 190	\$ 730 576	\$ 716 022

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Fonds Global High Yield Bond Fund	
	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	\$ 524 174	\$ 473 435	\$ 2 913 163	\$ 2 850 786
Fonds d'investissement	236 945	251 489	130 837	201 583
Contrats de mise en pension	18 513	18 536	3 895	11 412
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	41 444	29 087	36 787	36 885
Liquidités	3 006	12 189	1 899	26
Dépôts auprès de contreparties	29 989	40 674	14 859	28 611
Produits à recevoir	2 518	1 307	40 703	40 375
À recevoir sur investissements vendus	627	4 838	214	23
À recevoir sur investissements vendus TBA	118 316	90 163	0	0
À recevoir sur Actions du Fonds vendues	376	270	3 600	7 615
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	17 143	35 050	1 437	788
Autres actifs	0	0	30	223
Total des actifs à court terme	993 051	957 038	3 147 424	3 178 327
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(16 921)	(43 855)	(20 345)	(20 824)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(13 091)	(1 870)	(20 661)	0
À payer sur investissements achetés TBA	(257 057)	(117 381)	0	0
À payer sur Actions du Fonds rachetées	(526)	(10 695)	(3 938)	(13 817)
Frais de gestion à payer	(747)	(793)	(1 829)	(1 960)
À payer sur contrats de prise en pension	0	0	(11 985)	(10 397)
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	(3)	(3)	(25)	(123)
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	(40)	(40)	(4 628)	(4 126)
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(20 493)	(18 837)	(1 405)	(3 436)
Dépôts des contreparties	(15 586)	(13 488)	(12 772)	(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	(324 464)	(206 962)	(77 588)	(75 459)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	\$ 668 587	\$ 750 076	\$ 3 069 836	\$ 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 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
\$ 9 186 690	\$ 9 778 544	\$ 2 107 775	\$ 1 489 771	\$ 1 697 365	\$ 1 661 693	\$ 3 401 577	\$ 3 391 396
1 057 482	1 038 326	0	0	189	12 424	10 161	7 043
559 532	75 423	2 319	15 240	7 529	1 053	2 272	2 245
0	0	0	0	0	0	0	0
184 520	212 298	38 604	33 293	33 448	50 766	80 580	106 832
36 381	20 756	2 422	2 079	952	9 404	7 461	8 086
182 567	275 295	34 187	30 302	24 344	18 687	49 098	46 251
96 791	90 845	18 073	11 400	4 175	2 931	9 842	7 667
15 683	34 506	14 790	52 816	11 846	94 773	311	68 378
616 216	1 919 603	140 883	135 728	65 224	72 965	151 581	191 920
7 650	30 854	1 256	1 945	311	574	926	4 737
140 862	180 542	3 565	13 422	14 572	12 290	16 010	27 734
0	0	0	0	0	0	0	0
12 084 374	13 656 992	2 363 874	1 785 996	1 859 955	1 937 560	3 729 819	3 862 289
(202 313)	(293 790)	(21 813)	(17 969)	(30 763)	(29 733)	(74 956)	(93 426)
0	(136 255)	(31 398)	(5 887)	0	0	0	0
(23 751)	0	(3 691)	(8 117)	0	(30 524)	0	0
(1 235 486)	(2 481 720)	(287 441)	(202 456)	(130 717)	(132 585)	(303 432)	(325 573)
(14 213)	(32 381)	(518)	(188)	(2 188)	(2 607)	(2 782)	(3 628)
(5 637)	(5 738)	(826)	(605)	(686)	(735)	(1 339)	(1 447)
0	(4 154)	(151 412)	(75 928)	(408 892)	(261 713)	(791 310)	(796 152)
0	0	(30 833)	(75 925)	(9 212)	(79 599)	0	(9 519)
(299)	(339)	(137)	(124)	(2)	(2)	(41)	(51)
0	0	0	0	0	0	0	0
(8 969)	(6 988)	(1 221)	(692)	(1 752)	(446)	(6 199)	(2 363)
(69 607)	(82 017)	(4 982)	(13 852)	(13 375)	(18 182)	(21 429)	(35 345)
(31 248)	(75 269)	(10 253)	(14 363)	(9 211)	(17 059)	(17 662)	(22 923)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1 591 523)	(3 118 651)	(544 525)	(416 106)	(606 798)	(573 185)	(1 219 150)	(1 290 427)
\$ 10 492 851	\$ 10 538 341	\$ 1 819 349	\$ 1 369 890	\$ 1 253 157	\$ 1 364 375	\$ 2 510 669	\$ 2 571 862

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Income Fund		Fonds Income Fund II	
	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	\$ 79 018 485	\$ 67 246 471	\$ 94 891	\$ 56 970
Fonds d'investissement	2 484 042	2 081 428	7 607	1 740
Contrats de mise en pension	2 090 601	3 421 698	0	0
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	5 006 709	5 163 114	1 651	718
Liquidités	45 836	89 931	827	644
Dépôts auprès de contreparties	1 978 585	1 852 978	1 682	1 022
Produits à recevoir	404 136	354 824	615	384
À recevoir sur investissements vendus	64 631	60 282	4	5
À recevoir sur investissements vendus TBA	28 213 137	21 347 671	8 406	8 075
À recevoir sur Actions du Fonds vendues	106 957	88 371	743	4 020
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	1 569 675	1 235 828	889	637
Autres actifs	92	236	0	0
Total des actifs à court terme	120 982 886	102 942 832	117 315	74 215
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(3 761 324)	(3 649 860)	(1 393)	(406)
Juste valeur des titres vendus à découvert	(70 650)	(734 103)	(378)	0
À payer sur investissements achetés	(146 308)	(205 883)	0	(182)
À payer sur investissements achetés TBA	(49 488 695)	(37 310 306)	(16 684)	(15 917)
À payer sur Actions du Fonds rachetées	(40 562)	(145 081)	(20)	0
Frais de gestion à payer	(49 052)	(45 253)	(100)	(48)
À payer sur contrats de prise en pension	(8 320)	(15 867)	0	0
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	(5 655)	(4 925)	0	0
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	(3 122)	(2 737)	0	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(2 452 308)	(2 473 835)	(761)	(1 036)
Dépôts des contreparties	(429 323)	(374 655)	(260)	0
Autres passifs	0	0	(2)	(3)
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(56 455 319)	(44 962 505)	(19 598)	(17 592)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	\$ 64 527 567	\$ 57 980 327	\$ 97 717	\$ 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 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
\$ 293 906	\$ 320 121	\$ 1 153 664	\$ 1 235 606	\$ 821 335	\$ 691 422	\$ 1 708 028	\$ 1 213 608
63 568	68 975	84 133	85 631	6 316	643	145 966	106 140
4 101	40 720	0	956	563	1 604	326 492	98 831
0	0	0	0	0	0	0	0
10 980	14 716	6 520	7 284	13 215	13 518	100 490	79 359
1 115	0	259	2 692	308	390	3 660	6 374
8 501	8 179	13 041	24 403	9 733	10 136	44 502	34 272
697	688	8 329	6 394	7 517	5 082	7 169	7 264
9	13	697	723	0	202	8 771	2 215
49 198	10 546	389 587	380 707	44 465	69 997	999 381	367 632
47	100	100	976	247	2 763	1 399	2 070
5 757	7 201	7 778	7 914	4 269	11 170	23 725	21 540
0	0	0	0	0	0	0	0
437 879	471 259	1 664 108	1 753 286	907 968	806 927	3 369 583	1 939 305
(11 987)	(10 695)	(12 193)	(14 403)	(8 857)	(11 395)	(62 272)	(64 082)
0	0	(49 879)	(76 949)	0	(14 029)	0	(5 209)
0	(2 206)	(39)	(2 924)	(2 499)	(1 062)	(9 143)	(9 219)
(92 814)	(43 111)	(466 010)	(427 587)	(89 713)	(97 540)	(1 778 081)	(724 143)
(1 057)	(1 769)	(2 697)	(1 987)	(1 045)	(422)	(550)	(185)
(339)	(445)	(409)	(495)	(348)	(289)	(719)	(565)
0	0	(221 985)	(144 857)	0	(12 776)	0	0
0	0	(19 674)	(4 077)	0	(1 409)	0	0
(3)	(5)	(9)	(10)	0	0	(24)	(24)
0	(980)	0	0	0	0	0	0
0	0	(27)	(13)	(41)	(20)	(547)	(247)
(4 797)	(6 644)	(1 876)	(3 315)	(1 852)	(4 014)	(42 165)	(28 430)
(2 704)	(2 326)	(3 298)	(3 911)	(5 396)	(9 222)	(20 697)	(22 821)
0	0	0	0	0	0	0	0
(113 701)	(68 181)	(778 096)	(680 528)	(109 751)	(152 178)	(1 914 198)	(854 925)
\$ 324 178	\$ 403 078	\$ 886 012	\$ 1 072 758	\$ 798 217	\$ 654 749	\$ 1 455 385	\$ 1 084 380

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Low Duration Opportunities Fund		Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	
	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	\$ 1 055 335	\$ 1 216 746	\$ 5 400	\$ 5 070
Fonds d'investissement	108 526	133 056	0	0
Contrats de mise en pension	94 887	118 800	0	0
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	53 359	55 664	40	22
Liquidités	2 982	3 357	152	122
Dépôts auprès de contreparties	36 099	57 806	50	31
Produits à recevoir	6 895	7 718	24	16
À recevoir sur investissements vendus	6 071	12 795	49	0
À recevoir sur investissements vendus TBA	382 392	282 511	1 029	274
À recevoir sur Actions du Fonds vendues	22	542	0	0
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	27 076	45 871	34	51
Autres actifs	0	0	0	0
Total des actifs à court terme	1 773 644	1 934 866	6 778	5 586
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(65 611)	(109 833)	(48)	(67)
Juste valeur des titres vendus à découvert	(45 584)	(94 108)	0	0
À payer sur investissements achetés	(4 371)	(12 575)	0	0
À payer sur investissements achetés TBA	(517 783)	(347 541)	(1 694)	(545)
À payer sur Actions du Fonds rachetées	(486)	(139)	0	0
Frais de gestion à payer	(403)	(542)	(2)	(2)
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	(8)	(8)	0	0
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	(996)	(1 377)	0	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(6 836)	(19 443)	(17)	(44)
Dépôts des contreparties	(10 189)	(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	(652 267)	(589 085)	(1 761)	(658)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	\$ 1 121 377	\$ 1 345 781	\$ 5 017	\$ 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 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
\$ 86 230	\$ 106 959	\$ 1 421 861	\$ 1 724 999	\$ 1 011 424	\$ 711 694	\$ 7 486	\$ 7 750
9 353	11 833	24	23	163 028	92 742	1 117	904
840	811	4 008	17 318	651 113	156 445	4 018	1 374
0	0	0	0	0	0	0	0
2 338	1 447	28 831	44 003	77 353	12 661	995	258
442	552	112	167	776	2 178	14	11
0	2 870	11 095	11 602	60 486	85 945	299	861
121	104	4 632	4 660	3 960	2 660	25	21
0	13	26 202	1 901	12	255	0	0
0	0	1 219 745	1 781 393	83 136	0	2 003	1 240
44	59	486	412	1 989	1 226	0	0
0	0	2 808	17 755	8 958	33 144	196	115
0	0	0	0	1	0	0	0
99 368	124 648	2 719 804	3 604 233	2 062 236	1 098 950	16 153	12 534
(357)	(237)	(12 291)	(17 225)	(9 682)	(30 319)	(144)	(293)
0	0	(390 149)	(518 212)	0	0	(339)	(583)
0	(2 379)	(189 373)	(194 452)	(1 295)	(37 060)	0	(583)
0	0	(1 138 427)	(1 654 287)	(185 803)	0	(3 439)	(1 310)
(81)	(834)	(79)	(596)	(1 980)	(1 097)	0	0
(86)	(109)	(407)	(547)	(1 018)	(656)	(6)	(6)
0	0	(345 192)	(316 493)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(9)	(8)	(9)	(5)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(24)	(21)	0	0	0	0
0	0	(8 285)	(18 210)	(24 067)	(15 583)	(298)	(231)
(1 753)	(952)	(15 232)	(35 034)	(34 423)	(5 491)	(380)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(2 277)	(4 511)	(2 099 468)	(2 755 085)	(258 277)	(90 211)	(4 606)	(3 006)
\$ 97 091	\$ 120 137	\$ 620 336	\$ 849 148	\$ 1 803 959	\$ 1 008 739	\$ 11 547	\$ 9 528

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Strategic Income Fund		Fonds Total Return Bond Fund	
	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	\$ 597 009	\$ 610 560	\$ 5 534 034	\$ 4 770 861
Fonds d'investissement	23 276	29 661	260 029	292 421
Contrats de mise en pension	2 001	781	1 321	170 895
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	50 874	53 205	58 332	110 789
Liquidités	622	4 623	14 565	15 733
Dépôts auprès de contreparties	11 635	11 922	95 186	120 293
Produits à recevoir	2 935	2 787	30 502	25 541
À recevoir sur investissements vendus	6 251	4 738	3 813	51 883
À recevoir sur investissements vendus TBA	313 035	224 967	1 761 849	2 180 028
À recevoir sur Actions du Fonds vendues	250	385	2 493	12 045
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	14 397	14 864	49 719	77 114
Autres actifs	0	0	0	0
Total des actifs à court terme	1 022 285	958 493	7 811 843	7 827 603
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(38 322)	(36 766)	(83 466)	(106 644)
Juste valeur des titres vendus à découvert	(8 958)	(13 092)	(68 600)	(68 457)
À payer sur investissements achetés	(32)	(741)	(2 498)	(6 344)
À payer sur investissements achetés TBA	(484 953)	(367 853)	(3 274 412)	(3 304 650)
À payer sur Actions du Fonds rachetées	(679)	(539)	(2 603)	(3 734)
Frais de gestion à payer	(505)	(585)	(2 665)	(2 652)
À payer sur contrats de prise en pension	0	0	(9 407)	(1 745)
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	(7 982)	(76 810)
Charges à payer	(14)	(17)	(215)	(210)
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	0	0	(167)	(186)
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(21 250)	(21 409)	(23 821)	(72 167)
Dépôts des contreparties	(5 636)	(10 934)	(9 638)	(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	(560 349)	(451 936)	(3 485 474)	(3 676 886)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	\$ 461 936	\$ 506 557	\$ 4 326 369	\$ 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 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022	Au 30 juin 2023	Au 31 décembre 2022
\$ 237 254	\$ 335 879	£ 345 995	£ 372 745	£ 289 477	£ 309 110	\$ 1 868 312	\$ 1 895 465
30 015	41 693	208	5 370	0	0	67 844	39 162
4 583	27 452	13 102	177	1 922	269	10 034	9 269
0	600	0	0	0	0	0	0
68 482	42 556	3 019	4 161	4 623	8 017	10 846	12 684
2 862	3 994	530	1 084	572	0	576	550
29 400	28 858	3 217	7 199	4 147	14 086	17 435	10 449
2 063	1 601	4 552	4 405	5 276	4 594	29 928	31 884
0	134	2	1 522	0	0	35	3 204
78 701	25 221	1 866	0	0	0	0	0
18	11 015	91	61	0	0	2 730	1 390
26 120	17 270	6 430	7 000	2 394	15 391	2 247	270
0	0	0	0	0	0	22	186
479 498	536 273	379 012	403 724	308 411	351 467	2 010 009	2 004 513
(55 552)	(44 109)	(3 004)	(1 718)	(1 799)	(3 697)	(2 128)	(1 517)
(31 575)	0	0	0	0	0	0	0
(73)	(523)	(1 698)	0	0	0	(5 603)	(4 262)
(49 182)	(30 301)	(6 493)	0	0	0	0	0
(239)	(3 552)	(178)	(70)	(3)	0	(6 335)	(2 743)
(310)	(453)	(104)	(127)	(113)	(131)	(1 114)	(1 173)
0	0	(25 054)	0	(2 915)	0	(9 486)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	0	0	0	0	0	(76)	(148)
0	0	0	0	0	(2 154)	0	0
(539)	(317)	(1 895)	(1 865)	(415)	(371)	(40)	(20)
(21 978)	(16 064)	(5 751)	(10 440)	(5 213)	(19 583)	(2 839)	(1 779)
(17 685)	(5 030)	0	(331)	(41)	(511)	(4 787)	(7 949)
0	0	0	0	0	0	0	0
(177 134)	(100 349)	(44 177)	(14 551)	(10 499)	(26 447)	(32 408)	(19 591)
\$ 302 364	\$ 435 924	£ 334 835	£ 389 173	£ 297 912	£ 325 020	\$ 1 977 601	\$ 1 984 922

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund		Fonds US Short-Term Fund	
	Au	Au	Au	Au
	30 juin 2023	31 décembre 2022	30 juin 2023	31 décembre 2022
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	\$ 384 707	\$ 346 399	\$ 2 175 664	\$ 1 891 711
Fonds d'investissement	43 534	38 657	206 887	226 018
Contrats de mise en pension	25 268	15 383	227 937	154 472
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	7 629	8 390	8 510	10 584
Liquidités	922	796	4 031	1 993
Dépôts auprès de contreparties	11 854	12 615	13 803	18 130
Produits à recevoir	4 197	3 400	11 805	12 016
À recevoir sur investissements vendus	782	27 549	670	4 313
À recevoir sur investissements vendus TBA	18 074	21 983	0	0
À recevoir sur Actions du Fonds vendues	278	2 561	2 294	6 106
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	2 177	5 621	4 922	5 389
Autres actifs	0	0	0	0
Total des actifs à court terme	499 422	483 354	2 656 523	2 330 732
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(2 679)	(7 500)	(7 229)	(5 824)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	(2 035)	0	0
À payer sur investissements achetés	(1 448)	0	(571 126)	(1 430)
À payer sur investissements achetés TBA	(43 153)	(39 829)	0	0
À payer sur Actions du Fonds rachetées	(949)	(58)	(3 299)	(2 669)
Frais de gestion à payer	(209)	(182)	(643)	(722)
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	(38 655)	0	0
Charges à payer	0	0	(4)	(4)
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	(303)	(156)	0	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(3 703)	(4 541)	(3 099)	(4 603)
Dépôts des contreparties	(2 185)	(1 876)	(4 219)	(5 365)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(54 629)	(94 832)	(589 619)	(20 617)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	\$ 444 793	\$ 388 522	\$ 2 066 904	\$ 2 310 115

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

* Le Total Société au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 a été ajusté pour tenir compte des investissements croisés et des soldes au nom de la Société. Veuillez vous reporter à la note 10 dans les Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

Total Société*

	Au 30 juin 2023		Au 31 décembre 2022
\$	175 726 198	\$	158 067 452
	7 615 215		7 205 963
	7 770 096		10 455 165
	64 638		11 759
	7 870 090		8 087 908
	298 962		369 095
	4 105 461		4 738 366
	1 205 157		1 097 303
	673 066		1 035 370
	44 050 900		36 037 151
	407 359		405 829
	2 872 421		3 520 113
	145		662
	252 659 708		231 032 136
	(6 099 929)		(7 088 064)
	(1 735 668)		(2 699 152)
	(1 710 524)		(3 353 495)
	(76 766 692)		(57 317 614)
	(162 124)		(417 932)
	(108 908)		(108 234)
	(2 905 029)		(2 874 391)
	(90 782)		(303 953)
	(7 910)		(7 630)
	0		(20 563)
	(47 128)		(30 796)
	(3 314 886)		(4 103 580)
	(1 405 852)		(1 182 210)
	(2)		(3)
	(94 355 434)		(79 507 617)
\$	158 304 274	\$	151 524 519

Compte de résultat

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	\$ 127 322	\$ 102 800	\$ 10 414	\$ 7 131
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	(127 920)	(172 495)	(11 781)	(13 972)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	16 031	(35 312)	2 220	(5 775)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	22	(103)	21	(144)
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	(6 170)	(629 811)	5 133	(40 925)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	(10 526)	(32 123)	(765)	(4 392)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(54)	(118)	(10)	(7)
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(1 295)	(767 162)	5 297	(58 084)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(9 601)	(10 534)	(1 035)	(1 032)
Frais de services	(145)	(376)	0	0
Frais de commercialisation	(68)	(98)	0	0
Autres charges	(2)	(2)	0	0
Total des charges	(9 816)	(11 010)	(1 035)	(1 032)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	8	8	2	2
Charges d'exploitation nettes	(9 808)	(11 002)	(1 033)	(1 030)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(11 103)	(778 164)	4 264	(59 114)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(61)	(235)	(30)	0
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(17 012)	(23 232)	(5 596)	(3 822)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	(545)	77	2	31
Total des frais financiers	(17 618)	(23 390)	(5 624)	(3 791)
Bénéfice/(perte) de la période avant impôt	(28 721)	(801 554)	(1 360)	(62 905)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	0	0	0	(3)
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de la période après impôt	(28 721)	(801 554)	(1 360)	(62 908)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	\$ (28 721)	\$ (801 554)	\$ (1 360)	\$ (62 908)

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 Capital Securities Fund		Fonds PIMCO Climate Bond Fund		Fonds Commodity Real Return Fund		Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
\$ 170 864	\$ 160 238	\$ 5 112	\$ 3 144	\$ 20 182	\$ 61 718	\$ 2 759	\$ 2 145
14	0	0	0	68	0	65	0
(550 340)	(59 121)	(10 449)	(3 827)	(45 548)	(23 145)	(173)	(1 716)
(4 548)	164 830	(2 927)	1 355	(118 831)	561 745	6	(2 772)
(7 044)	(57 669)	(394)	74	25	(7 225)	(28)	(46)
393 969	(1 651 927)	17 685	(60 258)	60 903	(162 956)	1 051	(11 044)
(35 289)	24 401	1 801	(9 486)	(14 337)	(266 379)	478	(1 710)
692	1 836	(19)	7	(685)	(327)	7	(2)
(31 682)	(1 417 412)	10 809	(68 991)	(98 223)	163 431	4 165	(15 145)
(27 395)	(35 732)	(887)	(878)	(6 190)	(10 564)	(528)	(686)
(551)	(965)	0	(5)	(67)	(146)	0	0
(603)	(669)	0	0	0	0	0	0
(167)	(191)	(8)	(8)	(1)	(1)	0	0
(28 716)	(37 557)	(895)	(891)	(6 258)	(10 711)	(528)	(686)
0	302	0	0	0	0	1	1
(28 716)	(37 255)	(895)	(891)	(6 258)	(10 711)	(527)	(685)
(60 398)	(1 454 667)	9 914	(69 882)	(104 481)	152 720	3 638	(15 830)
(9 931)	(1 484)	(4)	0	(9 408)	(151)	(6)	(149)
0	0	0	0	0	0	0	0
(39 969)	(42 121)	(1 972)	(1 074)	(566)	0	0	0
(1 417)	(2 130)	34	76	(34)	0	0	0
(51 317)	(45 735)	(1 942)	(998)	(10 008)	(151)	(6)	(149)
(111 715)	(1 500 402)	7 972	(70 880)	(114 489)	152 569	3 632	(15 979)
(26)	(315)	2	3	1	1	(1)	6
0	0	0	0	0	0	0	0
(111 741)	(1 500 717)	7 974	(70 877)	(114 488)	152 570	3 631	(15 973)
\$ (111 741)	\$ (1 500 717)	\$ 7 974	\$ (70 877)	\$ (114 488)	\$ 152 570	\$ 3 631	\$ (15 973)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Diversified Income Fund		Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	\$ 209 219	\$ 231 966	\$ 13 553	\$ 18 087
Autres produits	1 911	0	197	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	(184 578)	(248 907)	(12 205)	(17 443)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	65 169	(538 653)	12 129	(9 888)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	(10 292)	(71 471)	203	(2 883)
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	276 276	(2 134 224)	16 730	(160 520)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	25 065	(487 131)	8 649	(33 646)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	171	(4 272)	29	(278)
Total des revenus/(pertes) sur investissements	382 941	(3 252 692)	39 285	(206 571)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(45 117)	(67 929)	(2 456)	(4 479)
Frais de services	(312)	(291)	(9)	(17)
Frais de commercialisation	(365)	(540)	0	0
Autres charges	(217)	(241)	0	(1)
Total des charges	(46 011)	(69 001)	(2 465)	(4 497)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	464	1 070	1	76
Charges d'exploitation nettes	(45 547)	(67 931)	(2 464)	(4 421)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	337 394	(3 320 623)	36 821	(210 992)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(1 699)	(65)	(119)	(9)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(63 554)	(82 528)	(4 882)	(6 214)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	(2 594)	(4 287)	94	(228)
Total des frais financiers	(67 847)	(86 880)	(4 907)	(6 451)
Bénéfice/(perte) de la période avant impôt	269 547	(3 407 503)	31 914	(217 443)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(16)	209	0	16
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de la période après impôt	269 531	(3 407 294)	31 914	(217 427)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	\$ 269 531	\$ (3 407 294)	\$ 31 914	\$ (217 427)

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 Diversified Income ESG Fund a été lancé le 27 juillet 2022.

(2) Le Fonds Emerging Local Bond ESG Fund a été lancé le 27 juillet 2022.

Fonds Diversified Income ESG Fund ⁽¹⁾		Fonds Dynamic Bond Fund		Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		Fonds Emerging Local Bond Fund		Fonds Emerging Local Bond ESG Fund ⁽²⁾							
Période close le 30 juin 2023		Période close le 30 juin 2023		Période close le 30 juin 2022		Période close le 30 juin 2023		Période close le 30 juin 2023							
\$	701	\$	83 905	\$	39 672	€	60 266	€	26 755	\$	84 704	\$	56 141	\$	243
	0		2 045		0		0		0		498		0		0
	(2)		(3 875)		3 920		(123 631)		52 910		(8 824)		(103 116)		97
	(265)		50 224		(106 614)		(171 519)		87 867		41 594		38 937		47
	(307)		(22 506)		(4 667)		7 680		19 831		3 626		(8 902)		10
	(201)		14 326		(286 244)		162 189		(753 300)		97 627		(227 906)		327
	(205)		106 698		(60 781)		12 190		(125 561)		7 059		(23 421)		(47)
	0		586		(655)		22 296		897		(4 724)		(1 854)		0
	(279)		231 403		(415 369)		(30 529)		(690 601)		221 560		(270 121)		677
	(98)		(16 606)		(13 868)		(30 207)		(42 520)		(11 305)		(9 592)		(26)
	0		(84)		(105)		(19)		(19)		(36)		(59)		0
	0		(64)		(97)		0		0		0		0		0
	(1)		(3)		(1)		(175)		(209)		(1)		(1)		0
	(99)		(16 757)		(14 071)		(30 401)		(42 748)		(11 342)		(9 652)		(26)
	0		228		231		565		621		0		0		0
	(99)		(16 529)		(13 840)		(29 836)		(42 127)		(11 342)		(9 652)		(26)
	(378)		214 874		(429 209)		(60 365)		(732 728)		210 218		(279 773)		651
	0		(797)		(28)		(636)		(647)		(5 964)		(3 419)		(3)
	0		0		0		0		0		0		0		0
	0		(4 869)		(3 803)		(3 405)		(3 860)		(8 029)		(5 728)		(2)
	0		(47)		(684)		479		(107)		261		(8)		0
	0		(5 713)		(4 515)		(3 562)		(4 614)		(13 732)		(9 155)		(5)
	(378)		209 161		(433 724)		(63 927)		(737 342)		196 486		(288 928)		646
	(2)		(49)		11		(2 177)		(6 884)		(739)		(523)		(2)
	0		0		(11)		0		0		(673)		(154)		(9)
	(380)		209 112		(433 724)		(66 104)		(744 226)		195 074		(289 605)		635
\$	(380)	\$	209 112	\$	(433 724)	€	(66 104)	€	(744 226)	\$	195 074	\$	(289 605)	\$	635

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Emerging Markets Bond Fund		Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	\$ 108 490	\$ 102 966	\$ 69 582	\$ 60 303
Autres produits	1 298	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	(34 567)	(136 347)	(75 552)	(74 275)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	9 227	(113 944)	20 332	(105 036)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	2 144	(3 818)	944	(1 992)
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	81 031	(749 330)	107 494	(540 974)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	2 443	(70 546)	(2 752)	(49 893)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	858	(69)	122	(222)
Total des revenus/(pertes) sur investissements	170 924	(971 088)	120 170	(712 089)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(14 672)	(17 626)	(10 963)	(10 984)
Frais de services	(13)	(17)	(5)	(3)
Frais de commercialisation	(56)	(79)	(3)	(4)
Autres charges	(3)	(2)	(2)	(1)
Total des charges	(14 744)	(17 724)	(10 973)	(10 992)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	0	0	0	0
Charges d'exploitation nettes	(14 744)	(17 724)	(10 973)	(10 992)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	156 180	(988 812)	109 197	(723 081)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(2 991)	(482)	(1 483)	(114)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(19 646)	(27 780)	(13 396)	(13 814)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	156	254	(838)	547
Total des frais financiers	(22 481)	(28 008)	(15 717)	(13 381)
Bénéfice/(perte) de la période avant impôt	133 699	(1 016 820)	93 480	(736 462)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(119)	(59)	5	13
Impôt sur les plus-values	(5)	0	0	0
Bénéfice/(perte) de la période après impôt	133 575	(1 016 879)	93 485	(736 449)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	\$ 133 575	\$ (1 016 879)	\$ 93 485	\$ (736 449)

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 Corporate Bond Fund		Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		Fonds PIMCO ESG Income Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
\$ 4 269	\$ 3 937	\$ 5 081	\$ 4 790	\$ 558	\$ 321	\$ 5 673	\$ 1 828
274	0	0	0	144	0	0	0
(8 005)	(5 129)	(3 419)	(16 594)	168	(262)	(2 034)	(483)
2 942	(7 168)	4 580	1 705	670	(364)	(3 062)	559
1	(102)	(1 229)	502	122	(4)	251	(115)
7 136	(33 691)	4 216	(24 936)	103	(2 196)	3 258	(18 395)
(1 517)	(4 540)	2 929	(8 358)	(607)	497	(984)	(4 995)
6	(9)	17	(8)	14	(3)	81	43
5 106	(46 702)	12 175	(42 899)	1 172	(2 011)	3 183	(21 558)
(996)	(1 131)	(388)	(1 119)	(152)	(201)	(806)	(442)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	(21)	0
0	0	0	0	0	0	(6)	0
(996)	(1 131)	(388)	(1 119)	(152)	(201)	(833)	(442)
0	0	1	1	3	4	0	0
(996)	(1 131)	(387)	(1 118)	(149)	(197)	(833)	(442)
4 110	(47 833)	11 788	(44 017)	1 023	(2 208)	2 350	(22 000)
(29)	(2)	(14)	(9)	(7)	(1)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(23)	(7)	0	0	(1 248)	(365)
0	0	0	0	0	0	4	(2)
(29)	(2)	(37)	(16)	(7)	(1)	(1 244)	(367)
4 081	(47 835)	11 751	(44 033)	1 016	(2 209)	1 106	(22 367)
(5)	2	(40)	(44)	(1)	(6)	0	(8)
0	0	8	5	1	(1)	0	0
4 076	(47 833)	11 719	(44 072)	1 016	(2 216)	1 106	(22 375)
\$ 4 076	\$ (47 833)	\$ 11 719	\$ (44 072)	\$ 1 016	\$ (2 216)	\$ 1 106	\$ (22 375)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Euro Bond Fund		Fonds Euro Credit Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	€ 22 648	€ 15 324	€ 7 837	€ 6 146
Autres produits	359	0	17	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	(82 934)	(51 316)	(24 398)	(10 937)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	(31 337)	(69 476)	(961)	(45 245)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	4 011	1 769	371	2 065
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	67 301	(174 838)	28 907	(76 085)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	68 666	142	8 150	(16 858)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(603)	(929)	(594)	(104)
Total des revenus/(pertes) sur investissements	48 111	(279 324)	19 329	(141 018)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(4 987)	(5 840)	(1 453)	(2 174)
Frais de services	(30)	(34)	0	0
Frais de commercialisation	0	(6)	0	0
Autres charges	(1)	(1)	0	(1)
Total des charges	(5 018)	(5 881)	(1 453)	(2 175)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	329	275	89	92
Charges d'exploitation nettes	(4 689)	(5 606)	(1 364)	(2 083)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	43 422	(284 930)	17 965	(143 101)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(131)	(129)	(59)	(74)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(537)	(473)	(202)	(781)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	(35)	(4)	(9)	11
Total des frais financiers	(703)	(606)	(270)	(844)
Bénéfice/(perte) de la période avant impôt	42 719	(285 536)	17 695	(143 945)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(51)	2	0	1
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de la période après impôt	42 668	(285 534)	17 695	(143 944)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	€ 42 668	€ (285 534)	€ 17 695	€ (143 944)

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 Income Bond Fund		Fonds Euro Long Average Duration Fund		Fonds Euro Short-Term Fund		Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
€ 20 803	€ 22 950	€ 1 471	€ 871	€ 3 681	€ 1 448	€ 5 210	€ 2 919
6	0	63	0	12	0	0	0
(48 614)	(35 223)	(20 288)	(3 560)	(3 351)	(1 234)	(6 228)	(1 032)
9 453	(14 618)	(13 811)	(12 896)	1 343	4 763	678	(1 939)
5 817	7 059	243	32	(170)	996	117	179
49 623	(207 195)	21 727	(24 392)	4 196	(17 953)	8 574	(23 505)
4 948	(40 275)	15 292	(1 445)	(977)	2 434	60	(513)
251	175	(57)	(36)	134	62	(35)	(23)
42 287	(267 127)	4 640	(41 426)	4 868	(9 484)	8 376	(23 914)
(7 214)	(10 341)	(259)	(312)	(448)	(851)	(219)	(25)
(33)	(39)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(68)	(80)	0	0	0	0	0	0
(7 315)	(10 460)	(259)	(312)	(448)	(851)	(219)	(25)
195	142	12	4	0	0	19	15
(7 120)	(10 318)	(247)	(308)	(448)	(851)	(200)	(10)
35 167	(277 445)	4 393	(41 734)	4 420	(10 335)	8 176	(23 924)
(243)	(120)	(13)	(8)	(8)	(52)	(3)	(26)
0	0	0	0	0	0	0	0
(6 848)	(7 858)	0	0	0	0	0	0
(31)	(544)	0	0	0	0	0	0
(7 122)	(8 522)	(13)	(8)	(8)	(52)	(3)	(26)
28 045	(285 967)	4 380	(41 742)	4 412	(10 387)	8 173	(23 950)
(1)	2	(7)	0	2	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
28 044	(285 965)	4 373	(41 742)	4 414	(10 387)	8 173	(23 950)
€ 28 044	€ (285 965)	€ 4 373	€ (41 742)	€ 4 414	€ (10 387)	€ 8 173	€ (23 950)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Fonds Global Advantage Fund	
	€	€	\$	\$
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	2 654	2 451	7 573	8 331
Autres produits	2	0	166	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	(8 500)	(6 872)	(8 671)	(4 236)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	1 303	9 870	3 498	(8 952)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	155	565	316	(477)
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	9 649	(25 579)	14 032	(64 938)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	(3 786)	9 133	(6 890)	(7 107)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	14	(182)	(299)	1 595
Total des revenus/(pertes) sur investissements	1 491	(10 614)	9 725	(75 784)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(355)	(645)	(1 465)	(1 725)
Frais de services	0	0	0	0
Frais de commercialisation	0	0	0	0
Autres charges	0	0	0	0
Total des charges	(355)	(645)	(1 465)	(1 725)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	25	49	0	0
Charges d'exploitation nettes	(330)	(596)	(1 465)	(1 725)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	1 161	(11 210)	8 260	(77 509)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(17)	(30)	(81)	(51)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	0	0	(2 225)	(1 978)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	0	0	0	0
Total des frais financiers	(17)	(30)	(2 306)	(2 029)
Bénéfice/(perte) de la période avant impôt	1 144	(11 240)	5 954	(79 538)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(5)	0	(6)	(13)
Impôt sur les plus-values	0	0	(8)	9
Bénéfice/(perte) de la période après impôt	1 139	(11 240)	5 940	(79 542)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	€ 1 139	€ (11 240)	\$ 5 940	\$ (79 542)

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 Bond Fund		Fonds Global Bond ESG Fund		Fonds Global Bond Ex-US Fund		Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
\$ 172 649	\$ 135 508	\$ 50 235	\$ 17 566	\$ 10 248	\$ 9 449	\$ 12 416	\$ 6 371
3 707	0	0	0	285	0	729	0
(144 975)	(138 224)	(6 283)	(64 696)	(4 851)	(5 494)	(2 455)	(16 957)
(60 657)	70 835	(74 830)	(12 939)	(9 960)	11 576	20 337	(117 852)
(21 493)	(45 306)	(201)	(9 773)	(1 230)	(4 054)	(2 083)	(127)
1 883	(1 646 386)	(49 756)	(277 444)	(6 532)	(110 407)	(15 061)	(59 134)
428 444	(259 223)	148 590	(64 724)	39 158	14 705	39 440	(35 070)
(7 263)	17 446	(1 859)	(501)	(839)	2 461	(409)	(281)
372 295	(1 865 350)	65 896	(412 511)	26 279	(81 764)	52 914	(223 050)
(36 839)	(39 175)	(8 138)	(5 582)	(1 949)	(2 261)	(4 774)	(5 477)
(766)	(718)	(17)	(19)	(12)	(16)	(18)	(16)
(58)	(56)	0	(2)	(26)	(30)	0	0
(63)	(71)	(2)	(1)	0	0	0	0
(37 726)	(40 020)	(8 157)	(5 604)	(1 987)	(2 307)	(4 792)	(5 493)
1 396	1 564	0	0	1	1	166	176
(36 330)	(38 456)	(8 157)	(5 604)	(1 986)	(2 306)	(4 626)	(5 317)
335 965	(1 903 806)	57 739	(418 115)	24 293	(84 070)	48 288	(228 367)
(2 651)	(640)	(746)	(55)	(173)	(79)	(260)	(41)
0	0	0	0	0	0	0	0
(16 775)	(14 147)	(7 316)	(3 468)	(1 208)	(901)	(1 398)	(1 527)
714	(326)	(378)	117	44	(68)	(29)	(363)
(18 712)	(15 113)	(8 440)	(3 406)	(1 337)	(1 048)	(1 687)	(1 931)
317 253	(1 918 919)	49 299	(421 521)	22 956	(85 118)	46 601	(230 298)
4	(225)	(658)	(37)	(3)	(12)	(295)	(373)
0	(3)	0	0	0	0	0	0
317 257	(1 919 147)	48 641	(421 558)	22 953	(85 130)	46 306	(230 671)
\$ 317 257	\$ (1 919 147)	\$ 48 641	\$ (421 558)	\$ 22 953	\$ (85 130)	\$ 46 306	\$ (230 671)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Global High Yield Bond Fund		Fonds Global Investment Grade Credit Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	\$ 82 477	\$ 102 882	\$ 213 040	\$ 206 572
Autres produits	996	0	3 970	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	(64 412)	(8 163)	(320 703)	(364 265)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	32 096	(87 771)	31 909	(436 718)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	(3 581)	(13 879)	(10 330)	(38 102)
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	136 901	(831 242)	483 163	(2 030 117)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	351	(71 956)	69 898	(223 463)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(613)	(274)	(1 441)	(6 696)
Total des revenus/(pertes) sur investissements	184 215	(910 403)	469 506	(2 892 789)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(11 191)	(15 462)	(35 438)	(42 302)
Frais de services	(17)	(32)	(1 200)	(1 376)
Frais de commercialisation	(121)	(187)	(591)	(785)
Autres charges	(19)	(21)	(70)	(83)
Total des charges	(11 348)	(15 702)	(37 299)	(44 546)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	0	0	445	449
Charges d'exploitation nettes	(11 348)	(15 702)	(36 854)	(44 097)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	172 867	(926 105)	432 652	(2 936 886)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(394)	(63)	(989)	(1 584)
Frais de facilité de crédit	(350)	(313)	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(26 056)	(33 177)	(49 362)	(55 106)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	65	385	482	(3 834)
Total des frais financiers	(26 735)	(33 168)	(49 869)	(60 524)
Bénéfice/(perte) de la période avant impôt	146 132	(959 273)	382 783	(2 997 410)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	0	0	(188)	(227)
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de la période après impôt	146 132	(959 273)	382 595	(2 997 637)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	\$ 146 132	\$ (959 273)	\$ 382 595	\$ (2 997 637)

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 ESG Fund		Fonds Global Low Duration Real Return Fund		Fonds Global Real Return Fund		Fonds Income Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
\$ 32 154	\$ 17 311	\$ 26 758	\$ 43 394	\$ 29 916	\$ 130 217	\$ 1 539 543	\$ 1 081 564
0	0	0	0	1 734	0	0	0
(38 347)	(19 154)	(22 734)	(18 461)	(65 319)	(82 178)	(890 181)	(1 327 161)
(11 095)	(23 201)	19 436	19 213	15 092	154 697	866 814	388 804
(293)	(8 975)	72	(3 491)	(3 548)	(16 457)	(34 847)	(63 921)
55 391	(264 585)	35 544	(110 034)	129 216	(791 364)	977 376	(7 982 341)
1 426	(39 232)	(20 176)	(14 347)	(11 965)	2 983	(257 063)	(885 815)
(179)	(386)	338	201	736	95	36 810	9 998
39 057	(338 222)	39 238	(83 525)	95 862	(602 007)	2 238 452	(8 778 872)
(4 209)	(3 579)	(4 389)	(3 656)	(8 243)	(10 799)	(287 322)	(296 445)
0	0	(12)	(11)	(152)	(248)	(6 709)	(8 044)
(798)	(722)	0	0	(103)	(167)	(15 644)	(15 404)
(1)	(1)	(1)	(1)	(2)	(2)	(1 729)	(1 892)
(5 008)	(4 302)	(4 402)	(3 668)	(8 500)	(11 216)	(311 404)	(321 785)
0	0	0	0	0	0	499	504
(5 008)	(4 302)	(4 402)	(3 668)	(8 500)	(11 216)	(310 905)	(321 281)
34 049	(342 524)	34 836	(87 193)	87 362	(613 223)	1 927 547	(9 100 153)
(3 342)	(116)	(8 678)	(481)	(19 567)	(2 042)	(8 155)	(1 638)
0	0	0	0	0	0	0	0
(7 612)	(5 659)	(3 796)	(4 566)	(16 743)	(21 808)	(968 561)	(690 822)
(440)	826	(29)	(33)	46	(33)	(2 574)	(2 945)
(11 394)	(4 949)	(12 503)	(5 080)	(36 264)	(23 883)	(979 290)	(695 405)
22 655	(347 473)	22 333	(92 273)	51 098	(637 106)	948 257	(9 795 558)
(56)	(27)	(46)	0	(1)	8	(8 186)	(1 468)
0	0	0	0	0	(1)	(443)	(122)
22 599	(347 500)	22 287	(92 273)	51 097	(637 099)	939 628	(9 797 148)
\$ 22 599	\$ (347 500)	\$ 22 287	\$ (92 273)	\$ 51 097	\$ (637 099)	\$ 939 628	\$ (9 797 148)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Income Fund II		Fonds Inflation Multi-Asset Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	\$ 2 160	\$ 494	\$ 4 991	\$ 7 876
Autres produits	0	0	2	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	(190)	(332)	(2 963)	1 543
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	(405)	126	616	14 169
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	122	(4)	1 000	(1 098)
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	886	(3 661)	7 057	(39 135)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	(69)	(38)	(4 752)	(19 924)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	24	5	72	34
Total des revenus/(pertes) sur investissements	2 528	(3 410)	6 023	(36 535)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(531)	(130)	(2 281)	(2 015)
Frais de services	0	0	0	0
Frais de commercialisation	0	0	(21)	(14)
Autres charges	(2)	(1)	0	0
Total des charges	(533)	(131)	(2 302)	(2 029)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	0	0	0	0
Charges d'exploitation nettes	(533)	(131)	(2 302)	(2 029)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	1 995	(3 541)	3 721	(38 564)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(71)	0	(64)	(2)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(1 680)	(187)	(323)	(359)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	58	4	(4)	40
Total des frais financiers	(1 693)	(183)	(391)	(321)
Bénéfice/(perte) de la période avant impôt	302	(3 724)	3 330	(38 885)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(28)	0	(181)	(122)
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de la période après impôt	274	(3 724)	3 149	(39 007)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	\$ 274	\$ (3 724)	\$ 3 149	\$ (39 007)

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 Low Average Duration Fund		Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Fonds Low Duration Income Fund		Fonds Low Duration Opportunities Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
\$ 21 660	\$ 10 329	\$ 14 194	\$ 6 056	\$ 31 699	\$ 17 978	\$ 23 132	\$ 26 353
447	0	0	0	0	0	0	0
(18 982)	(22 364)	(5 391)	(9 517)	(17 630)	(32 369)	(20 610)	(8 053)
(7 707)	9 023	127	(31 826)	10 780	(29 879)	(1 233)	(155 897)
9	(1 331)	(334)	(2 046)	(423)	75	8 451	(5 750)
19 793	(62 880)	10 639	(47 040)	23 985	(105 544)	34 966	(256 550)
1 302	2 631	2 379	(19 231)	23 185	(31 490)	40 725	(149 249)
(417)	(70)	(66)	(94)	558	(143)	76	(277)
16 105	(64 662)	21 548	(103 698)	72 154	(181 372)	85 507	(549 423)
(2 723)	(4 068)	(1 994)	(1 907)	(4 028)	(4 242)	(2 886)	(8 069)
(32)	(47)	0	0	0	(1)	(8)	(12)
(25)	(30)	0	0	0	0	0	0
(1)	(1)	0	0	(1)	(1)	(1)	(2)
(2 781)	(4 146)	(1 994)	(1 907)	(4 029)	(4 244)	(2 895)	(8 083)
83	84	0	0	0	0	106	107
(2 698)	(4 062)	(1 994)	(1 907)	(4 029)	(4 244)	(2 789)	(7 976)
13 407	(68 724)	19 554	(105 605)	68 125	(185 616)	82 718	(557 399)
(3 162)	(53)	(532)	(46)	(275)	(12)	(269)	(43)
0	0	0	0	0	0	0	0
(879)	(384)	(248)	(202)	(2 284)	(2 762)	(4 241)	(4 267)
(99)	4	(2)	21	224	(295)	(255)	(56)
(4 140)	(433)	(782)	(227)	(2 335)	(3 069)	(4 765)	(4 366)
9 267	(69 157)	18 772	(105 832)	65 790	(188 685)	77 953	(561 765)
(20)	(35)	(40)	0	(3)	(4)	89	(12)
0	0	0	0	0	0	0	(2)
9 247	(69 192)	18 732	(105 832)	65 787	(188 689)	78 042	(561 779)
\$ 9 247	\$ (69 192)	\$ 18 732	\$ (105 832)	\$ 65 787	\$ (188 689)	\$ 78 042	\$ (561 779)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund ⁽³⁾	Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Produits			
Produits des intérêts et dividendes	\$ 103	\$ 2 443	\$ 1 872
Autres produits	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	20	1 586	8 257
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	(47)	3 968	9 466
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	(4)	22	(32)
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	(6)	(3 390)	(3 270)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	37	771	(9 022)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(1)	6	(3)
Total des revenus/(pertes) sur investissements	102	5 406	7 268
Charges d'exploitation			
Frais de gestion	(13)	(565)	(677)
Frais de services	0	0	0
Frais de commercialisation	0	0	0
Autres charges	0	0	0
Total des charges	(13)	(565)	(677)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	0	0	0
Charges d'exploitation nettes	(13)	(565)	(677)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	89	4 841	6 591
Frais financiers			
Frais des intérêts	0	(20)	(2)
Frais de facilité de crédit	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(1)	(658)	(1 019)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	0	(35)	(162)
Total des frais financiers	(1)	(713)	(1 183)
Bénéfice/(perte) de la période avant impôt	88	4 128	5 408
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	0	(333)	(501)
Impôt sur les plus-values	0	0	0
Bénéfice/(perte) de la période après impôt	88	3 795	4 907
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	\$ 88	\$ 3 795	\$ 4 907

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.

⁽³⁾ Le Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund a été lancé le 27 juillet 2022.

Fonds Mortgage Opportunities Fund		Fonds StocksPLUS™ Fund		Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Fonds Strategic Income Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
\$ 23 325	\$ 34 884	\$ 31 119	\$ 15 113	\$ 207	\$ 60	\$ 12 823	\$ 12 792
6	0	36	0	0	0	0	0
(58 626)	(28 024)	(16 459)	(21 446)	(46)	48	(6 895)	687
10 480	1 021	109 846	(405 427)	686	(1 276)	10 817	(26 297)
(1 185)	(3 948)	(370)	(4 976)	(22)	0	(522)	71
66 020	(168 883)	24 785	(112 687)	13	(491)	11 162	(69 048)
(11 895)	(53 916)	85 329	(176 311)	886	(1 236)	(3 915)	(13 662)
1 457	108	8	(31)	0	(1)	264	(54)
29 582	(218 758)	234 294	(705 765)	1 724	(2 896)	23 734	(95 511)
(2 614)	(5 633)	(4 906)	(8 247)	(36)	(37)	(3 208)	(4 005)
(44)	(70)	(37)	(25)	0	0	0	0
(4)	0	0	0	0	0	0	0
0	(1)	(5)	(3)	0	0	(46)	(55)
(2 662)	(5 704)	(4 948)	(8 275)	(36)	(37)	(3 254)	(4 060)
0	0	0	0	1	1	0	0
(2 662)	(5 704)	(4 948)	(8 275)	(35)	(36)	(3 254)	(4 060)
26 920	(224 462)	229 346	(714 040)	1 689	(2 932)	20 480	(99 571)
(7 636)	(765)	(184)	(26)	0	0	(117)	(144)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1 407)	(5 834)	(434)	(41)	0	0	(2 691)	(2 798)
(450)	16	7	(2)	0	0	(62)	(22)
(9 493)	(6 583)	(611)	(69)	0	0	(2 870)	(2 964)
17 427	(231 045)	228 735	(714 109)	1 689	(2 932)	17 610	(102 535)
0	0	1	11	0	0	(704)	(557)
0	0	0	0	0	0	(5)	(2)
17 427	(231 045)	228 736	(714 098)	1 689	(2 932)	16 901	(103 094)
\$ 17 427	\$ (231 045)	\$ 228 736	\$ (714 098)	\$ 1 689	\$ (2 932)	\$ 16 901	\$ (103 094)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Total Return Bond Fund		Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	\$ 84 744	\$ 49 726	\$ 9 305	\$ 326
Autres produits	4 080	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	(54 618)	(191 151)	2 055	(3 031)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	(7 773)	45 966	(28 724)	11 123
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	(2 910)	(13 223)	(1 749)	(581)
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	117 352	(569 169)	(6 449)	(1 506)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	(29 541)	(31 153)	15 082	6 647
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	219	(293)	95	291
Total des revenus/(pertes) sur investissements	111 553	(709 297)	(10 385)	13 269
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(16 143)	(16 840)	(2 635)	(711)
Frais de services	(873)	(682)	(5)	0
Frais de commercialisation	(446)	(351)	0	0
Autres charges	(20)	(21)	0	0
Total des charges	(17 482)	(17 894)	(2 640)	(711)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	0	512	44	4
Charges d'exploitation nettes	(17 482)	(17 382)	(2 596)	(707)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	94 071	(726 679)	(12 981)	12 562
Frais financiers				
Frais des intérêts	(500)	(522)	(216)	(31)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(10 113)	(7 363)	(1 312)	0
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	(16)	6	12	0
Total des frais financiers	(10 629)	(7 879)	(1 516)	(31)
Bénéfice/(perte) de la période avant impôt	83 442	(734 558)	(14 497)	12 531
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(192)	3	0	0
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de la période après impôt	83 250	(734 555)	(14 497)	12 531
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	\$ 83 250	\$ (734 555)	\$ (14 497)	\$ 12 531

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 UK Corporate Bond Fund		Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund		Fonds US High Yield Bond Fund		Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
£ 7 122	£ 5 780	£ 6 796	£ 5 441	\$ 61 723	\$ 89 165	\$ 9 367	\$ 11 166
30	0	83	0	365	0	0	0
(8 084)	(6 552)	(13 392)	(13 229)	(62 031)	(14 111)	(4 417)	(54 490)
4 123	(7 824)	2 534	(12 538)	12 692	(48 533)	1 316	(27 266)
(10)	(76)	27	39	42	(1 248)	210	(521)
(3 359)	(65 594)	(2 332)	(69 491)	107 278	(580 152)	8 433	(69 863)
(2 489)	(2 182)	(1 462)	(3 480)	(2 449)	(25 796)	3 982	(18 953)
(65)	33	(31)	(18)	(33)	(29)	(65)	74
(2 732)	(76 415)	(7 777)	(93 276)	117 587	(580 704)	18 826	(159 853)
(671)	(1 069)	(721)	(879)	(6 895)	(10 592)	(1 212)	(1 722)
0	0	0	0	(471)	(722)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	(1)	(2)	0	0
(671)	(1 069)	(721)	(879)	(7 367)	(11 316)	(1 212)	(1 722)
5	2	0	0	0	0	0	0
(666)	(1 067)	(721)	(879)	(7 367)	(11 316)	(1 212)	(1 722)
(3 398)	(77 482)	(8 498)	(94 155)	110 220	(592 020)	17 614	(161 575)
(317)	(115)	(141)	(39)	(151)	0	(36)	(28)
0	0	0	0	(254)	(240)	0	0
(3 656)	(3 974)	(797)	(700)	(10 534)	(15 889)	(1 917)	(4 678)
(161)	24	(7)	(1)	115	46	89	(996)
(4 134)	(4 065)	(945)	(740)	(10 824)	(16 083)	(1 864)	(5 702)
(7 532)	(81 547)	(9 443)	(94 895)	99 396	(608 103)	15 750	(167 277)
0	6	0	0	0	(22)	(39)	(29)
0	0	0	0	0	0	0	0
(7 532)	(81 541)	(9 443)	(94 895)	99 396	(608 125)	15 711	(167 306)
£ (7 532)	£ (81 541)	£ (9 443)	£ (94 895)	\$ 99 396	\$ (608 125)	\$ 15 711	\$ (167 306)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds US Short-Term Fund		Total Société*	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	\$ 47 173	\$ 20 765	\$ 3 621 191	\$ 3 018 223
Autres produits	0	0	23 737	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	(28 034)	(32 581)	(3 311 905)	(3 410 275)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	2 688	32 774	833 179	(873 460)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	(876)	(616)	(90 477)	(362 866)
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	44 606	(98 443)	3 658 223	(24 536 624)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	(3 479)	21 526	744 967	(3 331 411)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(18)	(105)	47 262	16 998
Total des revenus/(pertes) sur investissements	62 060	(56 680)	5 526 177	(29 479 415)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(4 354)	(5 191)	(660 693)	(758 453)
Frais de services	(24)	(29)	(11 708)	(14 153)
Frais de commercialisation	0	0	(19 017)	(19 242)
Autres charges	(1)	(1)	(2 639)	(2 927)
Total des charges	(4 379)	(5 221)	(694 057)	(794 775)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	371	443	5 159	6 853
Charges d'exploitation nettes	(4 008)	(4 778)	(688 898)	(787 922)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	58 052	(61 458)	4 837 279	(30 267 337)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(231)	(747)	(92 810)	(16 747)
Frais de facilité de crédit	0	0	(604)	(553)
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(15 308)	(5 821)	(1 342 840)	(1 111 604)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	(44)	(13)	(7 256)	(14 711)
Total des frais financiers	(15 583)	(6 581)	(1 443 510)	(1 143 615)
Bénéfice/(perte) de la période avant impôt	42 469	(68 039)	3 393 769	(31 410 952)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	0	(18)	(14 296)	(11 872)
Impôt sur les plus-values	0	0	(1 134)	(282)
Bénéfice/(perte) de la période après impôt	42 469	(68 057)	3 378 339	(31 423 106)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	\$ 42 469	\$ (68 057)	\$ 3 378 339	\$ (31 423 106)

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 la période close le 30 juin 2023 et de la période close le 30 juin 2022 a été ajusté pour éliminer les investissements croisés. Veuillez vous reporter à la Note 10 dans les Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

(Cette page est laissée vierge volontairement)

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 Capital Securities Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Actifs nets au début de la période	\$ 2 981 392	\$ 3 411 923	\$ 313 987	\$ 361 011	\$ 5 721 591	\$ 9 110 409
Produits des actions émises	461 927	1 624 590	64 256	63 208	1 152 469	1 061 822
Produits des réinvestissements des distributions	2 598	4 497	681	316	4 901	5 034
Paiements au titre du rachat d'actions	(621 025)	(1 208 330)	(57 745)	(49 053)	(1 317 218)	(2 725 487)
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	(28 721)	(801 554)	(1 360)	(62 908)	(111 741)	(1 500 717)
Actifs nets à la fin de la période	\$ 2 796 171	\$ 3 031 126	\$ 319 819	\$ 312 574	\$ 5 450 002	\$ 5 951 061

	Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund		Fonds Diversified Income ESG Fund ⁽¹⁾	Fonds Dynamic Bond Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Actifs nets au début de la période	\$ 564 684	\$ 1 305 365	\$ 9 854	\$ 3 483 601	\$ 3 277 997
Produits des actions émises	16 092	37 493	50 269	187 421	312 414
Produits des réinvestissements des distributions	25	14	0	705	747
Paiements au titre du rachat d'actions	(91 148)	(315 292)	(1 754)	(513 546)	(721 606)
Ajustement du taux de change notionnel	0	0	0	0	0
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	31 914	(217 427)	(380)	209 112	(433 724)
Actifs nets à la fin de la période	\$ 521 567	\$ 810 153	\$ 57 989	\$ 3 367 293	\$ 2 435 828

	Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund		Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Actifs nets au début de la période	\$ 2 492 475	\$ 2 635 769	\$ 168 986	\$ 212 894	\$ 205 131	\$ 290 475
Produits des actions émises	298 339	948 977	3 563	11 490	38 588	64 474
Produits des réinvestissements des distributions	527	962	0	0	22	7
Paiements au titre du rachat d'actions	(522 493)	(652 057)	(16 892)	(21 579)	(24 892)	(41 842)
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	93 485	(736 449)	4 076	(47 833)	11 719	(44 072)
Actifs nets à la fin de la période	\$ 2 362 333	\$ 2 197 202	\$ 159 733	\$ 154 972	\$ 230 568	\$ 269 042

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

⁽¹⁾ Le Fonds Diversified Income ESG Fund a été lancé le 27 juillet 2022.

⁽²⁾ Le Fonds Emerging Local Bond ESG Fund a été lancé le 27 juillet 2022.

Fonds PIMCO Climate Bond Fund		Fonds Commodity Real Return Fund		Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Fonds Diversified Income Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
\$ 292 655	\$ 328 081	\$ 1 369 877	\$ 1 444 182	\$ 97 153	\$ 139 704	\$ 8 751 796	\$ 16 447 733
95 287	71 635	235 884	1 074 681	4 461	5 489	888 864	1 118 430
2	136	0	0	0	0	7 326	10 732
(106 394)	(54 800)	(518 107)	(859 208)	(5 449)	(8 275)	(1 974 800)	(4 099 599)
0	0	0	0	0	0	0	0
7 974	(70 877)	(114 488)	152 570	3 631	(15 973)	269 531	(3 407 294)
\$ 289 524	\$ 274 175	\$ 973 166	\$ 1 812 225	\$ 99 796	\$ 120 945	\$ 7 942 717	\$ 10 070 002
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		Fonds Emerging Local Bond Fund		Fonds Emerging Local Bond ESG Fund ⁽²⁾		Fonds Emerging Markets Bond Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
€ 5 115 170	€ 7 635 950	\$ 1 919 668	\$ 2 151 129	\$ 6 609		\$ 3 305 979	\$ 4 714 744
263 195	557 167	1 046 430	490 111	446		493 414	982 073
35	49	1 071	999	2		1 331	2 131
(1 054 085)	(1 367 212)	(376 800)	(499 751)	0		(544 652)	(1 467 932)
0	0	0	0	0		0	0
(66 104)	(744 226)	195 074	(289 605)	635		133 575	(1 016 879)
€ 4 258 211	€ 6 081 728	\$ 2 785 443	\$ 1 852 883	\$ 7 692		\$ 3 389 647	\$ 3 214 137
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		Fonds PIMCO ESG Income Fund		Fonds Euro Bond Fund		Fonds Euro Credit Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
\$ 20 937	\$ 29 760	\$ 237 961	\$ 125 087	€ 1 913 275	€ 2 574 129	€ 610 008	€ 1 017 163
2 533	7 100	109 092	72 168	242 427	211 134	84 231	246 063
0	0	432	95	0	0	0	235
(4 403)	(9 015)	(93 899)	(23 835)	(444 809)	(444 326)	(101 995)	(315 369)
0	0	0	0	0	0	0	0
1 016	(2 216)	1 106	(22 375)	42 668	(285 534)	17 695	(143 944)
\$ 20 083	\$ 25 629	\$ 254 692	\$ 151 140	€ 1 753 561	€ 2 055 403	€ 609 939	€ 804 148

État de l'évolution des actifs nets (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Euro Income Bond Fund		Fonds Euro Long Average Duration Fund		Fonds Euro Short-Term Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Actifs nets au début de la période	€ 1 352 980	€ 2 482 304	€ 110 048	€ 160 601	€ 353 095	€ 629 859
Produits des actions émises	130 742	357 731	362 362	18 010	23 762	32 982
Produits des réinvestissements des distributions	13	987	0	0	0	0
Paiements au titre du rachat d'actions	(249 609)	(944 650)	(26 818)	(21 658)	(167 912)	(145 195)
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	28 044	(285 965)	4 373	(41 742)	4 414	(10 387)
Actifs nets à la fin de la période	€ 1 262 170	€ 1 610 407	€ 449 965	€ 115 211	€ 213 359	€ 507 259
	Fonds Global Bond ESG Fund		Fonds Global Bond Ex-US Fund		Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Actifs nets au début de la période	\$ 3 106 190	\$ 2 302 966	\$ 716 022	\$ 911 707	\$ 750 076	\$ 1 035 021
Produits des actions émises	814 491	589 111	79 619	178 248	39 784	121 244
Produits des réinvestissements des distributions	3 499	1 948	454	348	4	3
Paiements au titre du rachat d'actions	(627 987)	(294 593)	(88 472)	(271 535)	(167 583)	(146 305)
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	48 641	(421 558)	22 953	(85 130)	46 306	(230 671)
Actifs nets à la fin de la période	\$ 3 344 834	\$ 2 177 874	\$ 730 576	\$ 733 638	\$ 668 587	\$ 779 292
	Fonds Global Real Return Fund		Fonds Income Fund		Fonds Income Fund II	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Actifs nets au début de la période	\$ 2 571 862	\$ 3 703 379	\$ 57 980 327	\$ 73 579 726	\$ 56 623	\$ 27 770
Produits des actions émises	270 535	511 183	13 763 965	9 993 226	86 951	9 537
Produits des réinvestissements des distributions	1 724	2 840	77 852	53 873	17	42
Paiements au titre du rachat d'actions	(384 549)	(783 240)	(8 234 205)	(16 972 510)	(46 148)	(1 548)
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	51 097	(637 099)	939 628	(9 797 148)	274	(3 724)
Actifs nets à la fin de la période	\$ 2 510 669	\$ 2 797 063	\$ 64 527 567	\$ 56 857 167	\$ 97 717	\$ 32 077

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

Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund		Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Fonds Global Advantage Fund		Fonds Global Bond Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
€ 174 162	€ 170 489	€ 211 172	€ 395 491	\$ 410 459	\$ 521 067	\$ 11 420 112	\$ 14 038 846
108 227	6 506	25 909	53 364	2 120	14 290	3 108 542	1 829 723
0	0	0	0	0	0	1 646	1 567
(65 889)	(9 060)	(90 342)	(163 937)	(6 904)	(20 204)	(2 235 847)	(2 625 242)
0	0	0	0	0	0	0	0
8 173	(23 950)	1 139	(11 240)	5 940	(79 542)	317 257	(1 919 147)
€ 224 673	€ 143 985	€ 147 878	€ 273 678	\$ 411 615	\$ 435 611	\$ 12 611 710	\$ 11 325 747
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	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 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
494 510	751 865	2 744 657	2 112 051	754 616	866 139	254 055	346 002
1 377	1 143	2 085	2 628	12	308	13	0
(675 051)	(1 438 485)	(3 174 827)	(5 254 660)	(327 768)	(282 014)	(387 573)	(470 577)
0	0	0	0	0	0	0	0
146 132	(959 273)	382 595	(2 997 637)	22 599	(347 500)	22 287	(92 273)
\$ 3 069 836	\$ 3 524 410	\$ 10 492 851	\$ 11 017 307	\$ 1 819 349	\$ 1 426 496	\$ 1 253 157	\$ 982 228
Fonds Inflation Multi-Asset Fund		Fonds Low Average Duration Fund		Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Fonds Low Duration Income Fund	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
\$ 403 078	\$ 164 345	\$ 1 072 758	\$ 1 179 138	\$ 654 749	\$ 806 869	\$ 1 084 380	\$ 1 367 475
13 707	396 530	71 088	1 094 731	159 600	88 461	437 266	469 983
73	102	306	131	172	101	58	25
(95 829)	(50 789)	(267 387)	(628 372)	(35 036)	(111 063)	(132 106)	(618 274)
0	0	0	0	0	0	0	0
3 149	(39 007)	9 247	(69 192)	18 732	(105 832)	65 787	(188 689)
\$ 324 178	\$ 471 181	\$ 886 012	\$ 1 576 436	\$ 798 217	\$ 678 536	\$ 1 455 385	\$ 1 030 520

État de l'évolution des actifs nets (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Low Duration Opportunities Fund		Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund ⁽³⁾		Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Actifs nets au début de la période	\$ 1 345 781	\$ 3 217 260	\$ 4 928		\$ 120 137	\$ 100 538
Produits des actions émises	248 767	779 899	0		4 956	62 957
Produits des réinvestissements des distributions	1 437	396	1		2	3
Paiements au titre du rachat d'actions	(552 650)	(414 455)	0		(31 799)	(47 316)
Ajustement du taux de change notionnel	0	0	0		0	0
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	78 042	(561 779)	88		3 795	4 907
Actifs nets à la fin de la période	\$ 1 121 377	\$ 3 021 321	\$ 5 017		\$ 97 091	\$ 121 089

	Fonds Total Return Bond Fund		Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		Fonds UK Corporate Bond Fund	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Actifs nets au début de la période	\$ 4 150 717	\$ 4 944 898	\$ 435 924	\$ 101 789	£ 389 173	£ 592 164
Produits des actions émises	670 578	577 403	111 465	21 844	35 847	56 101
Produits des réinvestissements des distributions	5 200	4 094	4	0	0	0
Paiements au titre du rachat d'actions	(583 376)	(727 420)	(230 532)	(12 472)	(82 653)	(61 666)
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	83 250	(734 555)	(14 497)	12 531	(7 532)	(81 541)
Actifs nets à la fin de la période	\$ 4 326 369	\$ 4 064 420	\$ 302 364	\$ 123 692	£ 334 835	£ 505 058

	Total Société*	
	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Actifs nets au début de la période	\$ 151 524 519	\$ 209 342 798
Produits des actions émises	32 330 533	33 462 234
Produits des réinvestissements des distributions	131 146	110 788
Paiements au titre du rachat d'actions	(29 325 755)	(53 479 245)
Ajustement du taux de change notionnel	265 492	(1 324 437)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	3 378 339	(31 423 106)
Actifs nets à la fin de la période	\$ 158 304 274	\$ 156 689 032

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

⁽³⁾ Le Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund a été lancé le 27 juillet 2022.

* Le Total Société de la période close le 30 juin 2023 et de la période close le 30 juin 2022 a été ajusté pour éliminer les investissements croisés. Veuillez vous reporter à la Note 10 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	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
\$ 849 148	\$ 2 238 424	\$1 008 739	\$3 761 156	\$ 9 528	\$ 11 610	\$ 506 557	\$ 619 928
82 072	880 678	825 580	538 574	1 073	1 393	20 350	131 886
198	2 537	429	41	0	0	13	5
(328 509)	(1 283 324)	(259 525)	(1 969 507)	(743)	(299)	(81 885)	(119 881)
0	0	0	0	0	0	0	0
17 427	(231 045)	228 736	(714 098)	1 689	(2 932)	16 901	(103 094)
\$ 620 336	\$ 1 607 270	\$ 1 803 959	\$1 616 166	\$ 11 547	\$ 9 772	\$ 461 936	\$ 528 844
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	
Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
£ 325 020	£ 425 748	\$1 984 922	\$3 923 786	\$ 388 522	\$ 878 100	\$ 2 310 115	\$ 2 650 198
1 886	34 072	289 270	548 535	144 702	92 249	328 573	845 504
1	1	1 930	3 080	30	3 268	12 934	5 244
(19 552)	(66 070)	(397 917)	(1 392 766)	(104 172)	(398 841)	(627 187)	(953 204)
0	0	0	0	0	0	0	0
(9 443)	(94 895)	99 396	(608 125)	15 711	(167 306)	42 469	(68 057)
£ 297 912	£ 298 856	\$1 977 601	\$2 474 510	\$ 444 793	\$ 407 470	\$2 066 904	\$2 479 685

Tableau des investissements Fonds PIMCO Asia High Yield 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 MOBILIERES											
AUSTRALIE											
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS											
Emeco Pty. Ltd. 6,250 % éch. 10/07/2026	AUD 11 810	\$ 7 313	0,26	10,875 % éch. 23/07/2023 ^	\$ 9 800	\$ 624	0,02	Yango Justice International Ltd. 7,500 % éch. 15/04/2024 ^	\$ 17 800	\$ 374	0,02
Mineral Resources Ltd. 8,000 % éch. 01/11/2027	\$ 16 040	16 034	0,57	11,700 % éch. 11/11/2025 ^	1 450	97	0,00	7,500 % éch. 17/02/2025 ^	3 000	26	0,00
8,125 % éch. 01/05/2027	4 996	5 001	0,18	11,950 % éch. 12/11/2023 ^	12 100	983	0,04	7,875 % éch. 04/09/2024 ^	5 800	87	0,00
Total Australie		28 348	1,01	11,950 % éch. 22/10/2049 ^	800	53	0,00	8,250 % éch. 25/11/2023 ^	4 400	66	0,00
BRESIL											
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS											
CSN Resources S.A. 4,625 % éch. 10/06/2031	5 000	3 822	0,14	KWG Group Holdings Ltd. 5,950 % éch. 10/08/2025 ^	16 723	1 782	0,06	9,250 % éch. 15/04/2023 ^	10 900	95	0,00
ILES CAÏMANS											
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES											
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd. 0,000 % éch. 22/01/2026 (c)	12 100	11 637	0,41	Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % éch. 06/06/2025	36 560	34 867	1,25	Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % éch. 19/08/2025	15 600	14 032	0,50
Meituan 0,000 % éch. 27/04/2028 (c)	14 200	11 679	0,42	5,250 % éch. 28/04/2026	8 324	7 713	0,28	ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % éch. 16/07/2025	18 180	16 089	0,58
Wynn Macau Ltd. 4,500 % éch. 07/03/2029	10 900	11 931	0,43	5,625 % éch. 17/07/2027	5 450	4 943	0,18	3,500 % éch. 08/03/2026	2 890	2 500	0,09
		35 247	1,26	5,750 % éch. 21/07/2028	47 477	42 017	1,50	Total Chine		51 211	1,83
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS											
AAC Technologies Holdings, Inc. 3,000 % éch. 27/11/2024	14 730	13 956	0,50	MGM China Holdings Ltd. 4,750 % éch. 01/02/2027	34 355	31 300	1,12	FRANCE			
Agile Group Holdings Ltd. 5,500 % éch. 21/04/2025	14 195	3 643	0,13	5,250 % éch. 18/06/2025	8 500	8 158	0,29	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
5,500 % éch. 17/05/2026	34 510	7 342	0,26	5,875 % éch. 15/05/2026	3 100	2 957	0,11	BNP Paribas S.A.			
5,750 % éch. 02/01/2025	4 000	1 230	0,04	New Metro Global Ltd. 4,500 % éch. 02/05/2026	5 200	2 197	0,08	7,750 % éch. 16/08/2029 (e)(g)	4 500	4 367	0,16
6,050 % éch. 13/10/2025	13 170	3 156	0,11	6,800 % éch. 05/08/2023	6 800	6 630	0,24	9,250 % éch. 17/11/2027 (e)(g)	4 100	4 235	0,15
7,875 % éch. 31/07/2024 (e)	6 077	800	0,03	PCPD Capital Ltd. 5,125 % éch. 18/06/2026	3 100	2 480	0,09	Société Générale S.A. 9,375 % éch. 22/11/2027 (e)(g)	8 600	8 428	0,30
China Hongqiao Group Ltd. 6,250 % éch. 08/06/2024	16 900	16 623	0,59	Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 5,950 % éch. 30/04/2025	17 745	1 837	0,07	Total France		17 030	0,61
China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % éch. 14/07/2026	23 100	19 791	0,71	6,250 % éch. 10/08/2024	1 130	113	0,00	ALLEMAGNE			
China SCE Group Holdings Ltd. 5,950 % éch. 29/09/2024	3 900	682	0,02	Sands China Ltd. 2,800 % éch. 08/03/2027	6 834	5 937	0,21	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
6,000 % éch. 04/02/2026	10 150	1 218	0,04	3,750 % éch. 08/08/2031	13 200	10 755	0,38	Deutsche Bank AG			
7,000 % éch. 02/05/2025	19 400	2 813	0,10	4,300 % éch. 08/01/2026	61 160	57 550	2,06	4,500 % éch. 30/11/2026 (e)(g)	€ 800	621	0,02
CIFI Holdings Group Co. Ltd. 5,250 % éch. 13/05/2026 ^	1 752	203	0,01	4,875 % éch. 18/06/2030	13 400	11 941	0,43	10,000 % éch. 01/12/2027 (e)(g)	5 600	6 072	0,22
5,950 % éch. 20/10/2025 ^	5 867	680	0,02	5,625 % éch. 08/08/2025	6 600	6 443	0,23	Total Allemagne		6 693	0,24
6,450 % éch. 07/11/2024 ^	16 695	1 963	0,07	5,900 % éch. 08/08/2028	26 300	25 094	0,90	HONG KONG			
6,550 % éch. 28/03/2024 ^	3 098	364	0,01	Seazen Group Ltd. 4,450 % éch. 13/07/2025	14 100	7 332	0,26	OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES			
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % éch. 12/07/2026	13 400	4 103	0,15	6,000 % éch. 12/08/2024	14 100	10 074	0,36	Universe Trek Ltd.			
3,125 % éch. 22/10/2025	19 580	6 171	0,22	Shui On Development Holding Ltd. 5,500 % éch. 29/06/2026	12 500	9 293	0,33	0,000 % éch. 15/06/2026 (c)	\$ 800	776	0,03
3,875 % éch. 22/10/2030	24 644	7 047	0,25	Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % éch. 26/04/2024 ^	3 800	570	0,02	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
4,200 % éch. 06/02/2026	18 000	5 739	0,21	6,500 % éch. 09/07/2023 ^	13 500	2 095	0,07	Bank of East Asia Ltd.			
4,800 % éch. 06/08/2030	8 300	2 404	0,09	6,500 % éch. 26/01/2026 ^	10 600	1 603	0,06	4,000 % éch. 29/05/2030 (g)	7 300	6 767	0,24
5,125 % éch. 14/01/2027	38 100	12 069	0,43	6,650 % éch. 03/08/2024 ^	19 400	2 865	0,10	4,875 % éch. 22/04/2032 (g)	8 400	7 579	0,27
5,400 % éch. 27/05/2025	8 090	2 996	0,11	6,800 % éch. 20/10/2024 ^	12 700	1 952	0,07	Fortune Star BVI Ltd.			
5,625 % éch. 15/12/2026	2 000	675	0,02	7,000 % éch. 09/07/2025 ^	9 200	1 391	0,05	3,950 % éch. 02/10/2026	€ 14 824	11 159	0,40
6,150 % éch. 17/09/2025	10 100	3 338	0,12	7,500 % éch. 01/02/2024 ^	2 000	300	0,01	5,000 % éch. 18/05/2026	\$ 26 100	19 602	0,70
6,500 % éch. 08/04/2024	6 000	3 562	0,13	7,950 % éch. 11/10/2023 ^	10 000	1 506	0,05	5,050 % éch. 27/01/2027	8 400	5 817	0,21
7,250 % éch. 08/04/2026	31 420	11 054	0,40	8,350 % éch. 19/04/2023 ^	19 200	2 839	0,10	5,950 % éch. 19/10/2025	10 100	8 096	0,29
8,000 % éch. 27/01/2024	9 100	5 980	0,21	Times China Holdings Ltd. 5,550 % éch. 04/06/2024 ^	16 400	1 168	0,04	GLP China Holdings Ltd. 2,950 % éch. 29/03/2026	10 250	6 384	0,23
eHi Car Services Ltd. 7,000 % éch. 21/09/2026	12 450	7 496	0,27	6,200 % éch. 22/03/2026 ^	8 000	611	0,02	Huarong Finance Co. Ltd. 3,250 % éch. 13/11/2024	13 900	13 048	0,47
7,750 % éch. 14/11/2024	10 900	8 115	0,29	6,600 % éch. 02/03/2023 ^	7 236	549	0,02	3,750 % éch. 29/05/2024	13 500	12 980	0,46
FWD Group Ltd. 5,750 % éch. 09/07/2024	200	197	0,01	6,750 % éch. 16/07/2023 ^	2 980	209	0,01	3,875 % éch. 13/11/2029	25 200	19 460	0,70
6,375 % éch. 13/09/2024 (e)	2 570	2 301	0,08	VLL International, Inc. 5,750 % éch. 28/11/2024	24 185	23 399	0,84	4,250 % éch. 07/11/2027	4 500	3 752	0,13
8,045 % éch. 15/12/2023 (e)	4 300	3 909	0,14	Wynn Macau Ltd. 4,875 % éch. 01/10/2024	10 471	10 221	0,37	4,500 % éch. 29/05/2029	18 500	14 846	0,53
FWD Ltd.											
5,000 % éch. 24/09/2024	200	196	0,01	5,125 % éch. 15/12/2029	2 851	2 398	0,09	4,625 % éch. 03/06/2026	3 700	3 298	0,12
Health & Happiness International Holdings Ltd. 13,500 % éch. 26/06/2026	25 635	24 271	0,87	5,500 % éch. 15/01/2026	32 544	30 264	1,08	4,750 % éch. 27/04/2027	18 100	15 676	0,56
Kaisa Group Holdings Ltd. 8,500 % éch. 30/06/2022 ^	17 900	1 197	0,04	5,500 % éch. 01/10/2027	19 713	17 569	0,63	4,875 % éch. 22/11/2026	7 180	6 359	0,23
8,500 % éch. 30/06/2024 ^	15 750	1 048	0,04	5,625 % éch. 26/08/2028	23 930	20 907	0,75	5,000 % éch. 19/11/2025	13 100	12 097	0,43
9,375 % éch. 30/06/2024 ^	13 200	883	0,03	Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % éch. 13/01/2026	2 850	2 599	0,09	6,625 % éch. 24/02/2025	5 200	4 893	0,18
9,750 % éch. 28/09/2023 ^	13 200	1 351	0,05	Total Îles Caïmans		609 199	21,79	Sino-Ocean Land Treasure Finance Ltd. 6,000 % éch. 30/07/2024	1 000	368	0,01
10,500 % éch. 15/01/2025 ^	20 200	1 351	0,05	CHINE							
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS							
				Flourish Century 6,600 % éch. 04/02/2022 ^ (h)	10 900	1 209	0,04	Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 2,700 % éch. 13/01/2025	21 200	6 731	0,24
				Greenland Global Investment Ltd. 5,875 % éch. 03/07/2026	7 150	1 251	0,05	3,250 % éch. 05/05/2026	32 250	9 964	0,36
				New Metro Global Ltd. 4,625 % éch. 15/10/2025	4 500	2 273	0,08	4,750 % éch. 05/08/2029	2 600	531	0,02
				4,800 % éch. 15/12/2024	14 300	9 790	0,35	4,750 % éch. 14/01/2030	14 000	2 898	0,10
				Yango Group Co. Ltd. 6,900 % éch. 31/10/2022 ^	CNY 40 000	292	0,01	Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % éch. 20/05/2026	20 199	16 633	0,59
										208 938	7,47
								Total Hong Kong		209 714	7,50
								INDE			
								OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
								Adani Green Energy Ltd.			
								4,375 % éch. 08/09/2024	4 800	4 440	0,16
								Adani Green Energy UP Ltd.			
								6,250 % éch. 10/12/2024	12 041	11 557	0,41

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
GMR Hyderabad International Airport Ltd.				Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.				6,500 % éch. 25/04/2024 (e)	\$ 1 750	\$ 1 566	0,06
4,250 % éch. 27/10/2027	\$ 4 878	\$ 4 323	0,15	5,500 % éch. 06/04/2025	\$ 47 441	\$ 45 585	1,63	7,000 % éch. 21/10/2025 (e)	16 884	14 183	0,51
4,750 % éch. 02/02/2026	25 175	24 006	0,86	India Airport Infra				Total Philippines		102 072	3,65
JSW Hydro Energy Ltd.				6,250 % éch. 25/10/2025	3 790	3 672	0,13	SINGAPOUR			
4,125 % éch. 18/05/2031	18 186	15 360	0,55	India Cleantech Energy				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Muthoot Finance Ltd.				4,700 % éch. 10/08/2026	5 127	4 498	0,16	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.			
4,400 % éch. 02/09/2023	4 776	4 745	0,17	India Green Energy Holdings				4,250 % éch. 25/03/2027	6 929	6 089	0,22
Periama Holdings LLC				5,375 % éch. 29/04/2024	28 073	27 451	0,98	GLP Pte. Ltd.			
5,950 % éch. 19/04/2026	63 700	61 450	2,20	India Green Power Holdings				4,500 % éch. 17/05/2026 (e)	13 300	4 974	0,18
ReNew Wind Energy AP2				4,000 % éch. 22/02/2027	6 102	5 339	0,19	4,600 % éch. 29/06/2027 (e)	7 000	2 625	0,09
4,500 % éch. 14/07/2028	30 988	26 438	0,95	India Toll Roads				Indika Energy Capital Pte. Ltd.			
Shriram Finance Ltd.				5,500 % éch. 19/08/2024	27 943	26 999	0,97	8,250 % éch. 22/10/2025	19 500	19 417	0,70
4,150 % éch. 18/07/2025	6 956	6 582	0,24	Total Île Maurice		165 245	5,91	Medco Bell Pte. Ltd.			
4,400 % éch. 13/03/2024	36 158	35 383	1,26					6,375 % éch. 30/01/2027	22 200	20 802	0,74
Total Inde		194 284	6,95	MEXIQUE				Medco Laurel Tree Pte. Ltd.			
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				6,950 % éch. 12/11/2028	2 500	2 296	0,08
INDONÉSIE				Banco Mercantil del Norte S.A.				TML Holdings Pte. Ltd.			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,875 % éch. 24/01/2027 (e)(g)	6 150	5 251	0,19	4,350 % éch. 09/06/2026	8 000	7 498	0,27
Adaro Indonesia PT				6,625 % éch. 24/01/2032 (e)(g)	4 650	3 599	0,13	5,500 % éch. 03/06/2024	13 524	13 375	0,48
4,250 % éch. 31/10/2024	23 174	22 317	0,80	Total Mexique		8 850	0,32	Total Singapour		77 076	2,76
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT								CORÉE DU SUD			
3,750 % éch. 30/03/2026 (g)	25 754	23 855	0,85	MONGOLIE				OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES			
Bukit Makmur Mandiri Utama PT				Obligation internationale du gouvernement mongol				POSCO Holdings, Inc.			
7,750 % éch. 10/02/2026	23 256	19 884	0,71	5,125 % éch. 07/04/2026	22 095	20 603	0,74	0,000 % éch. 01/09/2026 (c)	€ 7 200	8 062	0,29
Cikarang Listrindo Tbk PT				8,650 % éch. 19/01/2028	30 302	30 567	1,09	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
4,950 % éch. 14/09/2026	443	423	0,01	Total Mongolie		51 170	1,83	SK Broadband Co. Ltd.			
Medco Oak Tree Pte. Ltd.								4,875 % éch. 28/06/2028	\$ 12 950	12 770	0,46
7,375 % éch. 14/05/2026	17 800	17 527	0,63	PAYS-BAS				SK Hynix, Inc.			
Minejasa Capital BV				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				1,500 % éch. 19/01/2026	4 850	4 299	0,15
4,625 % éch. 10/08/2030	4 700	4 231	0,15	Mong Duong Finance Holdings BV				2,375 % éch. 19/01/2031	2 300	1 775	0,06
Pakuwon Jati Tbk PT				5,125 % éch. 02/02/2029	28 259	24 938	0,89	6,375 % éch. 17/01/2028	4 900	4 922	0,18
4,875 % éch. 29/04/2028	8 300	7 461	0,27	Prosus NV				Tongyang Life Insurance Co. Ltd.			
Saka Energi Indonesia PT				4,193 % éch. 19/01/2032	15 600	13 145	0,47	5,250 % éch. 22/09/2025 (e)	7 300	6 461	0,23
4,450 % éch. 05/05/2024	7 900	7 711	0,28	4,987 % éch. 19/01/2052	11 700	8 448	0,30	Total Singapour		30 227	1,08
Total Indonésie		103 409	3,70	Total Pays-Bas		46 531	1,66				
								ÉMISSIONS SOUVERAINES			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				OMAN				Export-Import Bank of Korea			
Obligation internationale du gouvernement indonésien				ÉMISSIONS SOUVERAINES				4,625 % éch. 07/06/2033	9 000	8 861	0,32
4,650 % éch. 20/09/2032	21 684	21 280	0,76	Obligation internationale du gouvernement omanais		4 600	0,16	Total Corée du Sud		47 150	1,69
Total Indonésie		124 689	4,46	PAKISTAN				SRI LANKA			
				ÉMISSIONS SOUVERAINES				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
JAPON				Obligation internationale du gouvernement pakistanais				5,750 % éch. 18/04/2023 ^	19 512	8 901	0,32
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				6,000 % éch. 08/04/2026	55 571	27 230	0,98	6,200 % éch. 11/05/2027 ^	23 800	10 958	0,39
ANA Holdings, Inc.				6,875 % éch. 05/12/2027	54 357	26 091	0,93	6,350 % éch. 28/06/2024 ^	9 500	4 375	0,16
0,000 % éch. 10/12/2031 (c)	¥ 860 000	7 343	0,26	7,375 % éch. 08/04/2031	25 300	11 701	0,42	6,750 % éch. 18/04/2028 ^	7 000	3 224	0,11
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				8,250 % éch. 15/04/2024	1 600	1 160	0,04	6,825 % éch. 18/07/2026 ^	4 500	2 132	0,08
Asahi Mutual Life Insurance Co.				8,250 % éch. 30/09/2025	6 635	3 616	0,13	6,850 % éch. 14/03/2024 ^	61 971	28 541	1,02
6,900 % éch. 26/01/2028 (e)	\$ 4 900	4 943	0,18	8,875 % éch. 08/04/2051	8 200	3 666	0,13	6,850 % éch. 03/11/2025 ^	39 900	19 013	0,68
Total Japon		12 286	0,44	Total Pakistan		73 464	2,63	7,550 % éch. 28/03/2030 ^	8 350	3 844	0,14
								7,850 % éch. 14/03/2029 ^	3 600	1 657	0,06
JERSEY, ILES ANGLO-NORMANDES				PHILIPPINES				Total Sri Lanka		82 645	2,96
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				THAÏLANDE			
West China Cement Ltd.				ACEN Finance Ltd.				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
4,950 % éch. 08/07/2026	30 075	23 081	0,82	4,000 % éch. 08/03/2025 (e)	14 900	10 456	0,37	Bangkok Bank PCL			
				Globe Telecom, Inc.				5,000 % éch. 23/09/2025 (e)(g)	21 400	20 300	0,73
LUXEMBOURG				3,000 % éch. 23/07/2035	8 150	6 134	0,22	Kasikornbank PCL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,200 % éch. 02/08/2026 (e)	24 100	22 443	0,80	3,343 % éch. 02/10/2031 (g)	3 200	2 828	0,10
Greensaif Pipelines Bidco SARL				ICTSI Treasury BV				5,275 % éch. 14/10/2025 (e)(g)	28 657	27 089	0,97
6,129 % éch. 23/02/2038	200	205	0,01	3,500 % éch. 16/11/2031	2 000	1 741	0,06	Muang Thai Life Assurance PCL			
Guara Norte SARL				Petron Corp.				3,552 % éch. 27/01/2037 (g)	23 300	20 201	0,72
5,198 % éch. 15/06/2034	4 421	3 876	0,14	4,600 % éch. 19/07/2023 (e)	2 100	2 095	0,07	Total Thaïlande		70 418	2,52
Total Luxembourg		4 081	0,15	5,950 % éch. 19/04/2026 (e)	6 260	5 822	0,21				
				Royal Capital BV				ROYAUME-UNI			
ÎLE MAURICE				4,875 % éch. 05/05/2024 (e)	10 571	10 435	0,37	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,000 % éch. 05/02/2026 (e)	900	875	0,03	Diamond Ltd.			
CA Magnum Holdings				San Miguel Corp.				7,950 % éch. 28/07/2026	3 700	3 643	0,13
5,375 % éch. 31/10/2026	34 160	30 671	1,10	5,500 % éch. 29/07/2025 (e)	10 150	9 161	0,33	Jaguar Land Rover Automotive PLC			
Greenko Dutch BV				SMC Global Power Holdings Corp.				4,500 % éch. 15/07/2028	€ 6 100	5 833	0,21
3,850 % éch. 29/03/2026	9 265	8 340	0,30	5,450 % éch. 09/12/2026 (e)	9 875	7 193	0,26				
Greenko Solar Mauritius Ltd.				5,700 % éch. 21/01/2026 (e)	3 754	2 834	0,10				
5,550 % éch. 29/01/2025	9 339	9 024	0,32	5,950 % éch. 05/05/2025 (e)	9 000	7 134	0,26				
5,950 % éch. 29/07/2026	3 900	3 666	0,13								

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
ÉTATS-UNIS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				INSTRUMENTS À COURT TERME			
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				BILLETS À COURT TERME			
Obligations du Trésor américain				Celestial Miles Ltd.				Yango Justice International Ltd.			
1,875 % éch. 15/11/2051	2 700	1 783	0,06	5,750 % éch.				10,250 % éch.			
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)				31/01/2024 (e)	\$ 26 054	\$ 25 730	0,92	15/09/2022 ^	\$ 4 500	\$ 90	0,00
0,125 % éch. 15/01/2032	49 895	43 949	1,57	Champion Path Holdings Ltd.				Total des instruments à court terme		90	0,00
		45 732	1,63	4,500 % éch. 27/01/2026	17 700	15 648	0,56	Total des valeurs mobilières	\$ 2 458 996		87,94
Total États-Unis		47 965	1,71	Easy Tactic Ltd. (6,500 % en numéraire ou 7,500 % de rémunération en nature)				ACTIONS			
VIETNAM				OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				FONDS D'INVESTISSEMENT			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
Vietnam Debt & Asset Trading Corp.				Obligations du Trésor américain				PIMCO Select Funds plc -			
1,000 % éch. 10/10/2025	1 300	1 101	0,04	1,875 % éch. 15/11/2051	2 700	1 783	0,06	Fonds PIMCO			
Obligation internationale du gouvernement vietnamien				0,125 % éch. 15/01/2032	49 895	43 949	1,57	US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	25 845 662	257 370	9,20
5,500 % éch. 12/03/2028	936	903	0,03	Total États-Unis		47 965	1,71	PIMCO Specialty Funds			
Total Vietnam		2 004	0,07	ÎLES VIERGES BRITANNIQUES				FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				FONDS D'INVESTISSEMENT			
ADM AG Holding Ltd.				Peak RE BVI Holding Ltd.				PIMCO ETFs plc -			
0,000 % éch.				5,350 % éch.				PIMCO US Dollar			
26/08/2023 (c)	9 000	8 908	0,32	28/10/2025 (e)	8 670	7 196	0,26	Short Maturity UCITS ETF (f)	48 700	4 837	0,17
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				FONDS D'INVESTISSEMENT			
				RKPF Overseas Ltd.				Total des Fonds d'investissement	\$ 271 904		9,72
				5,125 % éch. 26/07/2026	16 550	7 587	0,27				
				5,200 % éch. 12/01/2026	26 100	14 003	0,50				
				6,000 % éch. 04/09/2025	5 606	3 214	0,12				
				Studio City Co. Ltd.							
				7,000 % éch. 15/02/2027	7 000	6 565	0,23				
				Studio City Finance Ltd.							
				5,000 % éch. 15/01/2029	11 600	8 607	0,31				
				6,000 % éch. 15/07/2025	29 132	27 078	0,97				
				6,500 % éch. 15/01/2028	2 267	1 896	0,07				
				Wanda Properties Global Co. Ltd.							
				11,000 % éch.							
				20/01/2025	7 900	3 514	0,13				
				11,000 % éch.							
				13/02/2026	4 800	2 038	0,07				
				Wanda Properties International Co. Ltd.							
				7,250 % éch. 29/01/2024	2 000	1 248	0,04				
				Wanda Properties Overseas Ltd.							
				6,875 % éch. 23/07/2023	1 000	926	0,03				
						218 559	7,81				
				Total Îles Vierges britanniques		227 467	8,13				

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	
SSB	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 7 016	Billets du Trésor américain					
					1,875 % échéance					
					30/06/2026	\$ (7 156)	\$ 7 016	\$ 7 016	0,25	
Total des contrats de mise en pension							\$ (7 156)	\$ 7 016	\$ 7 016	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 Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	105	\$ 173	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	1 990	(4 156)	(0,15)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	7	(13)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	18	21	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	638	(78)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	23	44	0,00
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (4 009)	(0,14)

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 %	20/12/2024	€ 5 000	\$ 654	0,03
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20/06/2026	2 800	(153)	(0,01)
				\$ 501	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 ⁽³⁾	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,850 %	20/09/2033	¥ 3 800 000	\$ (215)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	16/06/2031	\$ 19 400	2 422	0,09
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2026	37 550	3 594	0,13
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	13 500	1 967	0,07
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/12/2031	28 100	2 197	0,08
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	114 000	(1 703)	(0,06)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/12/2051	39 300	4 546	0,16
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2033	KRW 41 093 606	(312)	(0,01)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,500	15/03/2028	42 889 600	246	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/09/2023	\$ 19 400	242	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/09/2023	37 550	415	0,01
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	€ 4 000	(14)	0,00
					\$ 13 385	0,48
					\$ 13 886	0,50

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.

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 - 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
BOA	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	(1,000) %	20/06/2028	\$ 44 900	\$ (648)	\$ (230)	\$ (878)	(0,03)

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
BPS	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20/06/2026	\$ 9 500	\$ (155)	\$ (968)	\$ (1 123)	(0,04)
BRC	BOC Aviation Ltd.	1,000	20/06/2026	24 300	(70)	118	48	0,00
	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.	1,000	20/06/2026	7 400	9	(512)	(503)	(0,02)
CBK	Obligation internationale du gouvernement vietnamien	1,000	20/12/2027	9 100	(263)	242	(21)	0,00
					\$ (479)	\$ (1 120)	\$ (1 599)	(0,06)

(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.

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
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,545 %	05/05/2028	MYR 127 400	\$ 0	\$ 150	\$ 150	0,01
GST	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	167 250	49	200	249	0,01
						\$ 49	\$ 350	\$ 399	0,02

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	08/2023	AUD	10 762	\$ 7 275	\$ 103	\$ 0	103	0,00
	08/2023	CNY	12 479	1 818	92	0	92	0,00
	08/2023	€	5 866	6 440	27	0	27	0,00
	08/2023	¥	4 117 200	28 826	158	0	158	0,01
	08/2023	NZD	237	150	5	0	5	0,00
	09/2023	TWD	125 459	4 133	96	0	96	0,00
	09/2023	\$	1 808	HKD 14 125	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	\$	20 504	IDR 306 940 703	0	(117)	(117)	0,00
	09/2023	\$	14 664	INR 1 212 899	79	0	79	0,00
BPS	07/2023	\$	13 749	MYR 63 110	0	(202)	(202)	(0,01)
	08/2023	CNY	14 674	\$ 2 146	116	0	116	0,00
	08/2023	€	1 483	1 590	0	(31)	(31)	0,00
	08/2023	TWD	62 796	2 057	40	0	40	0,00
	08/2023	\$	5 239	CNH 36 203	0	(246)	(246)	(0,01)
	08/2023	\$	6 684	€ 6 106	0	(9)	(9)	0,00
	09/2023	IDR	1 079 052	\$ 72	0	0	0	0,00
	09/2023	\$	0	THB 1	0	0	0	0,00
BRC	08/2023	€	442	\$ 476	0	(7)	(7)	0,00
	08/2023	\$	2 392	CNH 16 575	0	(106)	(106)	0,00
	08/2023	\$	6 903	¥ 913 551	0	(542)	(542)	(0,02)
	09/2023	PHP	462 920	\$ 8 260	0	(94)	(94)	0,00
CBK	07/2023	\$	1 594 596	29 231	404	0	404	0,02
	08/2023	€	5 301	5 802	7	0	7	0,00
	08/2023	¥	43 700	321	17	0	17	0,00
	08/2023	TWD	65 378	2 142	42	0	42	0,00
	08/2023	\$	14	CNH 100	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	PHP	294 148	\$ 5 253	0	(55)	(55)	0,00
	09/2023	\$	13 783	INR 1 133 307	0	(7)	(7)	0,00
DUB	08/2023	CNH	105 760	\$ 15 033	448	0	448	0,02
GLM	09/2023	TWD	7 303	240	5	0	5	0,00
	09/2023	\$	28 324	THB 977 177	0	(555)	(555)	(0,02)
JPM	07/2023	PHP	104 353	\$ 1 910	23	0	23	0,00
	08/2023	CNH	73 409	10 469	345	0	345	0,01
	08/2023	CNY	15 480	2 264	122	0	122	0,01
	08/2023	\$	4 205	CNH 29 061	0	(198)	(198)	(0,01)
	08/2023	\$	1 130	¥ 150 136	0	(85)	(85)	0,00
	09/2023	IDR	300 865	\$ 20	0	0	0	0,00
	09/2023	THB	7 662	223	6	0	6	0,00
	09/2023	\$	8 534	IDR 128 395 884	0	(5)	(5)	0,00
	09/2023	\$	54	INR 4 431	0	0	0	0,00
MBC	08/2023	CNH	139 191	\$ 20 213	1 018	0	1 018	0,04
	08/2023	€	25 777	28 444	263	0	263	0,01
	08/2023	\$	314	CNH 2 160	0	(16)	(16)	0,00
MYI	07/2023	£	13	\$ 16	0	0	0	0,00
	07/2023	IDR	80 913 271	5 410	14	0	14	0,00
	07/2023	\$	35	€ 32	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	186	£ 147	1	0	1	0,00
	07/2023	\$	5 385	IDR 80 913 271	12	0	12	0,00
	08/2023	TWD	67 573	\$ 2 228	58	0	58	0,00
	08/2023	\$	14 772	¥ 1 963 090	0	(1 103)	(1 103)	(0,04)
	09/2023	IDR	593 736	\$ 40	0	0	0	0,00
	09/2023	THB	3 492	102	3	0	3	0,00
	09/2023	\$	5 410	IDR 80 983 607	0	(32)	(32)	0,00
	09/2023	\$	12	INR 957	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	\$	13 783	MYR 63 348	0	(186)	(186)	(0,01)
	08/2023	CNY	41 104	\$ 6 021	334	0	334	0,01
	08/2023	NZD	84	52	1	0	1	0,00
	08/2023	\$	6 229	CNH 43 774	0	(192)	(192)	(0,01)
	08/2023	\$	14 352	TWD 436 304	0	(340)	(340)	(0,01)
	09/2023	IDR	299 775 204	\$ 20 160	247	0	247	0,01
	09/2023	THB	7 929	230	4	0	4	0,00
	09/2023	TWD	104 832	3 438	66	0	66	0,00
	09/2023	\$	34	INR 2 771	0	0	0	0,00
UAG	09/2023	SGD	37 928	\$ 28 379	273	0	273	0,01
	09/2023	\$	13 880	INR 1 147 440	68	0	68	0,00
					\$ 4 497	\$ (4 131)	\$ 366	0,01

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	355	\$ 236	\$ 0	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$	437	AUD 668	8	0	0,00
	08/2023		236	355	1	0	0,00
BOA	07/2023		1 370	2 106	33	(1)	0,01
	07/2023	AUD	2 029	\$ 1 342	0	(9)	0,00
	07/2023	\$	1 240	AUD 1 910	32	0	0,00
BPS	08/2023		1 206	1 820	6	0	0,00
	07/2023		277	425	6	0	0,00
	07/2023	AUD	626	\$ 416	0	(1)	0,00
SCX	07/2023	\$	337	AUD 516	6	0	0,00
	08/2023		416	626	1	0	0,00
	07/2023	AUD	2 111	\$ 1 402	2	(6)	0,00
UAG	07/2023	\$	520	AUD 795	9	0	0,00
	08/2023		1 403	2 111	7	(3)	0,00
					\$ 111	\$ (21)	\$ 90

Au 30 juin 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	07/2023	CHF	2 058	\$ 2 301	\$ 1	\$ 0	0,00
	07/2023	\$	3 157	CHF 2 857	36	0	0,00
	08/2023		2 301	2 052	0	(1)	0,00
MBC	07/2023		36	32	0	0	0,00
	07/2023	CHF	220	\$ 243	0	(3)	0,00
	07/2023	\$	53	CHF 48	1	0	0,00
SCX	07/2023	CHF	32	\$ 35	0	(1)	0,00
	07/2023	\$	2 156	CHF 1 938	9	0	0,00
	07/2023	CHF	2 126	\$ 2 372	0	(5)	0,00
UAG	07/2023	\$	1 954	CHF 1 756	9	0	0,00
	08/2023		2 372	2 120	5	0	0,00
					\$ 61	\$ (10)	\$ 51

Au 30 juin 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	
BOA	07/2023	€	2 159	\$ 2 359	\$ 4	\$ 0	0,00	
	07/2023	\$	165 988	€ 154 450	2 517	0	2 517	0,09
	07/2023	€	171 369	\$ 187 722	759	(1)	758	0,03
BPS	07/2023	\$	166 467	€ 154 852	2 477	0	2 477	0,09
	08/2023		174 611	159 137	0	(755)	(755)	(0,03)
	07/2023	€	175 663	\$ 190 718	2	(933)	(931)	(0,03)
CBK	07/2023	\$	55	€ 51	0	0	0	0,00
	08/2023		169 171	155 383	584	0	584	0,02
	07/2023	€	1 186	\$ 1 274	0	(20)	(20)	0,00
MBC	07/2023	\$	36 635	€ 34 083	550	0	550	0,02
	07/2023	€	6 144	\$ 6 709	6	0	6	0,00
	07/2023	\$	167 108	€ 156 151	3 253	0	3 253	0,11
				\$ 10 152	\$ (1 709)	\$ 8 443	0,30	

Au 30 juin 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	07/2023	£	19	\$ 24	\$ 0	\$ 0	0,00	
	07/2023		0	0	0	0	0,00	
BRC	07/2023	\$	470	£ 374	5	0	5	0,00
	07/2023	£	534	\$ 679	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	\$	45	£ 36	0	0	0	0,00
	07/2023		12 941	10 454	350	0	350	0,01
MBC	07/2023		13 008	10 466	298	0	298	0,01
	07/2023	£	3	\$ 4	0	0	0	0,00
UAG	07/2023	\$	13 374	£ 10 733	271	0	271	0,01
					\$ 924	\$ 0	\$ 924	0,03

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

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$ 466	CNH 3 309	\$ 0	\$ (11)	\$ (11)	0,00
BPS	07/2023	465	3 292	0	(12)	(12)	0,00
GLM	07/2023	CNH 3 462	\$ 477	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 468	CNH 3 302	0	(14)	(14)	0,00
	08/2023	477	3 454	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07/2023	29	204	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07/2023	10	71	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ (40)	\$ (39)	0,00

Au 30 juin 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
BRC	07/2023	\$ 6 713	SGD 9 084	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
GLM	07/2023	SGD 866	\$ 645	5	0	5	0,00
	07/2023	\$ 448	SGD 603	0	(3)	(3)	0,00
MBC	07/2023	6 157	8 318	0	(10)	(10)	0,00
	08/2023	20	27	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	SGD 9 341	\$ 6 913	10	0	10	0,00
	08/2023	\$ 6 764	SGD 9 131	0	(10)	(10)	0,00
SCX	07/2023	1 384	1 874	0	0	0	0,00
UAG	07/2023	6 801	9 198	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 15	\$ (28)	\$ (13)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 7 744 0,28

Total des Investissements

\$ 2 755 537 98,55

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 40 634 1,45

Actifs nets

\$ 2 796 171 100,00

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) Titres 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) Affilié au Fonds.
- (g) Titre convertible conditionnel.
- (h) 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	\$ 1 209	0,04

Un montant en numéraire de 21 139 \$ (31 décembre 2022 : 21 668 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 2 460 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 2 445 564	\$ 13 432	\$ 2 458 996
Fonds d'investissement	271 904	0	0	271 904
Contrats de mise en pension	0	7 016	0	7 016
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	173	17 448	0	17 621
Totaux	\$ 272 077	\$ 2 470 028	\$ 13 432	\$ 2 755 537

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 8	\$ (20)	\$ (12)	\$ 1 734	\$ (1 360)	\$ 374
BOA	2 105	(1 670)	435	(199)	350	151
BPS	1 078	(730)	348	(8 680)	9 734	1 054
BRC	(1 200)	1 210	10	(872)	1 172	300
CBK	45	0	45	4 080	(4 046)	34
DUB	448	(320)	128	1 048	(1 010)	38
GLM	(413)	590	177	96	0	96
GST	249	0	249	(732)	660	(72)
JPM	208	(290)	(82)	(538)	730	192
MBC	2 134	(2 060)	74	4 627	(4 030)	597
MYI	(751)	660	(91)	479	(240)	239
SCX	3 207	(2 920)	287	4 720	(4 520)	200
UAG	626	(610)	16	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	72,48	70,88
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	15,46	18,07
Fonds d'investissement	9,72	8,05
Contrats de mise en pension	0,25	0,69
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,14)	(0,01)
Instruments financiers dérivés compensés	0,50	0,47
Instruments financiers dérivés hors cote	0,28	0,45

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	1,01	1,12
Brésil	0,14	0,13
Îles Caïmans	23,05	26,52
Chine	1,83	1,91
France	0,61	0,59
Allemagne	0,24	0,38
Hong Kong	7,50	6,10
Inde	6,95	6,45
Indonésie	4,46	3,84
Israël	S/O	0,09
Japon	0,44	0,24
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,82	0,84
Luxembourg	0,15	0,13
Île Maurice	5,91	7,22
Mexique	0,32	0,37
Mongolie	1,83	1,30
Pays-Bas	1,66	1,80
Oman	0,16	0,16
Pakistan	2,63	2,18
Philippines	3,65	3,53
Singapour	2,76	3,90
Corée du Sud	1,69	0,20
Sri Lanka	2,96	1,91
Thaïlande	2,52	2,75
Royaume-Uni	4,74	3,67
États-Unis	1,71	1,57

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Vietnam	0,07	0,21
Îles Vierges britanniques	8,13	9,83
Instruments à court terme	0,00	0,01
Fonds d'investissement	9,72	8,05
Contrats de mise en pension	0,25	0,69
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,14)	(0,01)
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	0,03
Swaps de taux d'intérêt	0,48	0,45
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	(0,03)	(0,09)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,06)	(0,07)
Swaps de taux d'intérêt	0,02	S/O
Contrats de change à terme	0,01	0,06
Contrats de change à terme couverts	0,34	0,55
Autres actifs et passifs à court terme	1,45	1,40
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION VALEURS MOBILIÈRES	VALEUR NOMINALE (en 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
AUSTRALIE				FRANCE				FRANCE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Emeco Pty. Ltd. 6,250 % éch. 10/07/2026	AUD 1 300	\$ 805	0,25	FWD Group Ltd. 6,375 % éch. 13/09/2024 (e) 8,045 % éch. 15/12/2023 (e)	\$ 200	\$ 179	0,06	Huaxin Cement International Finance Co. Ltd. 2,250 % éch. 19/11/2025	\$ 900	\$ 806	0,25
Mineral Resources Ltd. 8,000 % éch. 01/11/2027 8,125 % éch. 13/03/2027	\$ 1 000	1 000	0,31	Geely Automobile Holdings Ltd. 4,000 % éch. 09/12/2024 (e)	2 000	1 915	0,60	Midea Investment Development Co. Ltd. 2,880 % éch. 24/02/2027	1 500	1 358	0,42
Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % éch. 22/03/2028	900	818	0,25	Goodman HK Finance 3,000 % éch. 22/07/2030	700	594	0,19	New Metro Global Ltd. 4,625 % éch. 15/10/2025 4,800 % éch. 15/12/2024	1 140	576	0,18
Santos Finance Ltd. 3,649 % éch. 29/04/2031 5,250 % éch. 01/05/2027	600	499	0,16	Health & Happiness International Holdings Ltd. 13,500 % éch. 26/06/2026	2 800	2 651	0,83	SF Holding Investment Ltd. 2,375 % éch. 17/11/2026	600	540	0,17
Woodside Finance Ltd. 3,700 % éch. 15/09/2026	1 600	1 506	0,47	Kaisa Group Holdings Ltd. 9,375 % éch. 30/06/2024 ^ 9,750 % éch. 28/09/2023 ^ 10,500 % éch. 15/01/2025 ^ 11,250 % éch. 09/04/2022 ^ 11,950 % éch. 12/11/2023 ^ 11,950 % éch. 22/10/2049 ^	800	53	0,02	Yango Group Co. Ltd. 6,900 % éch. 31/10/2022 ^	CNY 20 000	146	0,05
Total Australie		5 610	1,75	Longfor Group Holdings Ltd. 3,950 % éch. 16/09/2029 4,500 % éch. 16/01/2028	400	300	0,09	Yango Justice International Ltd. 7,875 % éch. 04/09/2024 ^	\$ 700	11	0,00
BRÉSIL				Melco Resorts Finance Ltd.				Yunda Holding Investment Ltd.			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
CSN Resources S.A. 4,625 % éch. 10/06/2031	400	306	0,10	4,875 % éch. 06/06/2025 5,250 % éch. 26/04/2026 5,750 % éch. 21/07/2028	900	858	0,27	ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % éch. 16/07/2025	2 500	2 212	0,69
ILES CAIMANS				MGM China Holdings Ltd.				Total Chine			
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd. 0,000 % éch. 22/01/2026 (c)	900	866	0,27	4,750 % éch. 01/02/2027 5,250 % éch. 18/06/2025	1 600	1 458	0,46	BNP Paribas S.A. 9,250 % éch. 17/11/2027 (e)(g)	700	723	0,22
Meituan 0,000 % éch. 27/04/2027 (c) 0,000 % éch. 27/04/2028 (c)	1 400	1 228	0,38	Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 5,950 % éch. 30/04/2025 6,250 % éch. 10/08/2024	200	192	0,06	Société Générale S.A. 9,375 % éch. 22/11/2027 (e)(g)	1 000	980	0,31
Wynn Macau Ltd. 4,500 % éch. 07/03/2029	1 300	1 423	0,45	Sands China Ltd. 2,800 % éch. 08/03/2027 4,875 % éch. 18/06/2030 5,625 % éch. 08/08/2025 5,900 % éch. 08/08/2028	1 500	1 303	0,41	Total France		1 703	0,53
		3 928	1,23	Seazen Group Ltd. 4,450 % éch. 13/07/2025 6,000 % éch. 12/08/2024	400	41	0,01	ALLEMAGNE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Shui On Development Holding Ltd.				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AAC Technologies Holdings, Inc. 3,000 % éch. 27/11/2024 3,750 % éch. 02/06/2031	1 700	1 611	0,50	5,500 % éch. 29/06/2026	700	520	0,16	BMW Finance NV 3,440 % éch. 15/06/2024	CNY 7 000	971	0,30
Agile Group Holdings Ltd. 5,500 % éch. 17/05/2026 6,050 % éch. 13/10/2025 7,875 % éch. 31/07/2024 (e)	2 500	532	0,17	Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % éch. 26/04/2024 ^ 6,500 % éch. 10/01/2025 ^ 6,650 % éch. 03/08/2024 ^ 6,800 % éch. 20/10/2024 ^ 7,950 % éch. 11/10/2023 ^ 8,350 % éch. 19/04/2023 ^	1 500	1 064	0,32	Deutsche Bank AG 4,500 % éch. 30/11/2026 (e)(g) 10,000 % éch. 01/12/2027 (e)(g)	€ 200	155	0,05
Alibaba Group Holding Ltd. 2,125 % éch. 09/02/2031 2,700 % éch. 09/02/2041 4,500 % éch. 28/11/2034	800	652	0,20	Tencent Holdings Ltd. 3,240 % éch. 03/06/2050	1 100	723	0,23	Total Allemagne		1 560	0,49
Baidu, Inc. 4,375 % éch. 29/03/2028	1 000	954	0,30	Times China Holdings Ltd. 5,550 % éch. 04/06/2024 ^	1 900	135	0,04	HONG KONG			
China Hongqiao Group Ltd. 6,250 % éch. 08/06/2024	1 400	1 377	0,43	VLL International, Inc. 5,750 % éch. 28/11/2024	200	194	0,06	OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES			
China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % éch. 14/07/2026	2 200	1 885	0,59	Wynn Macau Ltd. 4,875 % éch. 01/10/2024 5,500 % éch. 15/01/2026 5,500 % éch. 01/10/2027 5,625 % éch. 26/08/2028	2 250	2 196	0,69	Universe Trek Ltd. 0,000 % éch. 15/06/2026 (c)	\$ 200	194	0,06
China SCE Group Holdings Ltd. 5,950 % éch. 29/09/2024 6,000 % éch. 04/02/2026	200	35	0,01	Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % éch. 13/01/2026	1 650	1 505	0,47	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
CIFI Holdings Group Co. Ltd. 4,450 % éch. 17/09/2026 ^ 4,800 % éch. 17/05/2028 ^ 5,950 % éch. 20/10/2025 ^ 6,000 % éch. 16/07/2025 ^	100	11	0,00	Total Îles Caïmans		49 967	15,62	Bank of East Asia Ltd. 6,750 % éch. 15/03/2027	1 700	1 681	0,53
CK Hutchison International Ltd. 4,750 % éch. 21/04/2028 4,875 % éch. 21/04/2033	1 500	1 484	0,46	CHINE				China Cinda Finance Ltd. 4,750 % éch. 08/02/2028	1 000	960	0,30
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % éch. 12/07/2026 3,125 % éch. 22/10/2025 3,875 % éch. 22/10/2030 4,200 % éch. 06/02/2026 4,800 % éch. 06/08/2030 5,125 % éch. 14/01/2027 5,625 % éch. 14/01/2030 6,150 % éch. 17/09/2025 7,250 % éch. 08/04/2026	200	61	0,02	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % éch. 02/10/2026 5,000 % éch. 18/05/2026 5,050 % éch. 27/01/2027 5,950 % éch. 19/10/2025 6,850 % éch. 02/07/2024	€ 800	602	0,19
eHi Car Services Ltd. 7,000 % éch. 21/09/2026 7,750 % éch. 14/11/2024	1 400	843	0,26	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				GLP China Holdings Ltd. 2,950 % éch. 29/03/2026 4,974 % éch. 26/02/2024	\$ 700	526	0,16
	500	394	0,12	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Huarong Finance Co. Ltd. 4,250 % éch. 07/11/2027 4,500 % éch. 29/05/2029 4,625 % éch. 03/06/2026 4,875 % éch. 22/11/2026 5,000 % éch. 19/11/2025 6,625 % éch. 24/02/2025	700	485	0,15
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Lenovo Group Ltd. 6,536 % éch. 27/07/2032	400	481	0,15
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Sino-Ocean Land Treasury Ltd. 2,700 % éch. 13/01/2025 3,250 % éch. 05/05/2026 4,750 % éch. 05/08/2029 4,750 % éch. 14/01/2030	900	561	0,18
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % éch. 20/05/2026	400	356	0,11
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					500	417	0,13
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					4 800	3 852	1,20
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					300	267	0,08
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					400	354	0,11
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					500	462	0,14
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					400	376	0,12
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					700	707	0,22
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					1 400	444	0,14
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					1 000	309	0,10
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					400	82	0,03
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					1 000	207	0,07
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					600	494	0,15
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS						13 803	4,32

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

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Airport Authority Hong Kong 2,500 % éch. 12/01/2032	\$ 3 600	\$ 3 065	0,96
4,750 % éch. 12/01/2028	1 250	1 247	0,39
4,875 % éch. 12/01/2030	1 300	1 322	0,41
		5 634	1,76

Total Hong Kong 19 631 6,14

INDE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Adani Electricity Mumbai Ltd. 3,949 % éch. 12/02/2030	1 200	893	0,28
Adani Green Energy UP Ltd. 6,250 % éch. 10/12/2024	1 000	960	0,30
Adani Transmission Step-One Ltd. 4,000 % éch. 03/08/2026	800	700	0,22
GMR Hyderabad International Airport Ltd. 4,250 % éch. 27/10/2027	2 000	1 773	0,56
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % éch. 21/01/2032	2 100	1 833	0,57
JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % éch. 18/05/2031	924	780	0,24
Muthoot Finance Ltd. 4,400 % éch. 02/09/2023	791	786	0,25
Network I2i Ltd. 5,650 % éch. 15/01/2025 (e)	200	195	0,06
NTPC Ltd. 4,250 % éch. 26/02/2026	600	578	0,18
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd. 3,750 % éch. 27/07/2026	1 000	946	0,30
Reliance Industries Ltd. 2,875 % éch. 12/01/2032	700	584	0,18
Shriram Finance Ltd. 4,150 % éch. 18/07/2025	958	907	0,28
4,400 % éch. 13/03/2024	2 480	2 427	0,76
UltraTech Cement Ltd. 2,800 % éch. 16/02/2031	2 100	1 727	0,54
Total Inde		15 089	4,72

INDONÉSIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Bank Mandiri Persero Tbk PT 5,500 % éch. 04/04/2026	1 800	1 800	0,56
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3,750 % éch. 30/03/2026 (g)	2 220	2 056	0,64
4,300 % éch. 24/03/2027 (e)(g)	450	373	0,12
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT 4,625 % éch. 20/07/2023	3 000	2 998	0,94
Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7,750 % éch. 10/02/2026	2 200	1 881	0,59
Cikarang Listrindo Tbk PT 4,950 % éch. 14/09/2026	400	382	0,12
Freeport Indonesia PT 4,763 % éch. 14/04/2027	700	679	0,21
5,315 % éch. 14/04/2032	1 600	1 517	0,47
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 3,541 % éch. 27/04/2032	700	590	0,19
Indonesia Asahan Aluminium PT 5,800 % éch. 15/05/2050	1 200	1 060	0,33
LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % éch. 04/02/2039	993	892	0,28
Medco Oak Tree Pte. Ltd. 7,375 % éch. 14/05/2026	1 800	1 772	0,55
Minejasa Capital BV 4,625 % éch. 10/08/2030	400	360	0,11
Pakuwon Jati Tbk PT 4,875 % éch. 29/04/2028	200	180	0,06
Pelabuhan Indonesia Persero PT 4,875 % éch. 01/10/2024	700	694	0,22
Pertamina Persero PT 1,400 % éch. 09/02/2026	700	633	0,20
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,375 % éch. 05/02/2030	2 300	2 020	0,63

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Saka Energi Indonesia PT 4,450 % éch. 05/05/2024	\$ 700	\$ 683	0,21
		20 570	6,43

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,650 % éch. 20/09/2032	2 900	2 846	0,89
5,250 % éch. 17/01/2042	900	900	0,28
		3 746	1,17

Total Indonésie 24 316 7,60

IRLANDE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

SMBC Aviation Capital Finance DAC 5,450 % éch. 03/05/2028	3 200	3 159	0,99
--	-------	-------	------

JAPON OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES

ANA Holdings, Inc. 0,000 % éch. 10/12/2031 (c)	¥ 90 000	768	0,24
---	----------	-----	------

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Asahi Mutual Life Insurance Co. 6,900 % éch. 26/01/2028 (e)	\$ 600	606	0,19
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,063 % éch. 12/09/2025	2 900	2 866	0,90
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 4,800 % éch. 15/09/2025	2 900	2 845	0,89
		6 317	1,98
Total Japon		7 085	2,22

JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

West China Cement Ltd. 4,950 % éch. 08/07/2026	1 700	1 305	0,41
---	-------	-------	------

LUXEMBOURG OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Guara Norte SARL 5,198 % éch. 15/06/2034	796	698	0,22
---	-----	-----	------

MALAISIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Genm Capital Labuan Ltd. 3,882 % éch. 19/04/2031	500	405	0,13
Khazanah Capital Ltd. 4,876 % éch. 01/06/2033	300	297	0,09
Khazanah Global Sukuk Bhd. 4,687 % éch. 01/06/2028	1 200	1 185	0,37
Misc Capital Two Labuan Ltd. 3,625 % éch. 06/04/2025	3 900	3 751	1,17
Petronas Capital Ltd. 2,480 % éch. 28/01/2032	600	502	0,16
3,404 % éch. 28/04/2061	550	393	0,12
Petronas Energy Canada Ltd. 2,112 % éch. 23/03/2028	700	622	0,19
		7 155	2,23

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Export-Import Bank of Malaysia Bhd. 1,831 % éch. 26/11/2026	1 000	888	0,28
Total Malaisie		8 043	2,51

ÎLE MAURICE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

CA Magnum Holdings 5,375 % éch. 31/10/2026	2 500	2 245	0,70
Greenko Dutch BV 3,850 % éch. 29/03/2026	2 632	2 369	0,74
India Cleantech Energy 4,700 % éch. 10/08/2026	275	241	0,08
India Green Energy Holdings 5,375 % éch. 29/04/2024	3 400	3 325	1,04

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
India Toll Roads 5,500 % éch. 19/08/2024	\$ 2 000	\$ 1 932	0,60
Total Île Maurice		10 112	3,16

MEXIQUE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Banco Mercantil del Norte S.A. 5,875 % éch. 24/01/2027 (e)(g)	850	726	0,23
--	-----	-----	------

MONGOLIE ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement mongol 4,450 % éch. 07/07/2031	1 600	1 244	0,39
8,650 % éch. 19/01/2028	1 530	1 543	0,48
Total Mongolie		2 787	0,87

PAYS-BAS OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % éch. 07/05/2029	2 000	1 765	0,55
Prosus NV 4,193 % éch. 19/01/2032	1 200	1 011	0,32
4,987 % éch. 19/01/2052	900	650	0,20
Total Pays-Bas		3 426	1,07

PAKISTAN ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement pakistanais 6,000 % éch. 08/04/2026	2 950	1 445	0,45
6,875 % éch. 05/12/2027	4 200	2 016	0,63
Total Pakistan		3 461	1,08

PHILIPPINES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Globe Telecom, Inc. 3,000 % éch. 23/07/2035	200	151	0,05
4,200 % éch. 02/08/2026 (e)	900	838	0,26
SMC Global Power Holdings Corp. 5,450 % éch. 09/12/2026 (e)	300	218	0,07
6,500 % éch. 25/04/2024 (e)	800	716	0,22
7,000 % éch. 21/10/2025 (e)	200	168	0,05
		2 091	0,65

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement philippin 1,750 % éch. 28/04/2041	€ 1 400	996	0,31
3,200 % éch. 06/07/2046	\$ 900	666	0,21
5,000 % éch. 17/07/2033	600	608	0,19
5,000 % éch. 13/01/2037	200	200	0,06
5,609 % éch. 13/04/2033	800	847	0,27
		3 317	1,04

Total Philippines 5 408 1,69

SINGAPOUR OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

BOC Aviation Ltd. 3,500 % éch. 10/10/2024	1 500	1 451	0,45
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. 4,250 % éch. 25/03/2027	744	654	0,21
Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % éch. 22/10/2025	1 150	1 145	0,36
Medco Bell Pte. Ltd. 6,375 % éch. 30/01/2027	778	729	0,23
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 4,602 % éch. 15/06/2032 (g)	2 700	2 618	0,82
TML Holdings Pte. Ltd. 5,500 % éch. 03/06/2024	2 100	2 077	0,65
United Overseas Bank Ltd. 1,750 % éch. 16/03/2031 (g)	800	712	0,22
Total Singapour		9 386	2,94

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CORÉE DU SUD			
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES			
POSCO Holdings, Inc. 0,000 % éch. 01/09/2026 (c) €	800	896	0,28
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Hana Bank 3,250 % éch. 30/03/2027	\$ 2 300	2 155	0,67
KB Capital Co. Ltd. 1,500 % éch. 28/10/2025	700	629	0,20
Kodit Global Co. Ltd. 4,954 % éch. 25/05/2026	1 500	1 477	0,46
Kookmin Bank 2,500 % éch. 04/11/2030 (g)	1 400	1 137	0,36
POSCO 5,750 % éch. 17/01/2028	3 700	3 755	1,17
Shinhan Bank Co. Ltd. 4,000 % éch. 23/04/2029 (g)	200	182	0,06
Shinhan Card Co. Ltd. 2,500 % éch. 27/01/2027	3 400	3 034	0,95
SK Broadband Co. Ltd. 4,875 % éch. 28/06/2028	1 500	1 479	0,46
SK Hynix, Inc. 1,500 % éch. 19/01/2026	200	177	0,05
2,375 % éch. 19/01/2031	2 720	2 100	0,66
SK on Co. Ltd. 5,375 % éch. 11/05/2026	3 200	3 175	0,99
Tongyang Life Insurance Co. Ltd. 5,250 % éch. 22/09/2025 (e)	1 700	1 504	0,47
Woori Bank 4,875 % éch. 26/01/2028	1 800	1 783	0,56
		22 587	7,06
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Export-Import Bank of Korea 5,125 % éch. 11/01/2033	300	308	0,10
Korea Electric Power Corp. 5,375 % éch. 06/04/2026	5 700	5 683	1,78
Korea Housing Finance Corp. 4,625 % éch. 24/02/2028	6 800	6 703	2,09
Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp. 5,375 % éch. 11/05/2028	2 250	2 217	0,69
Korea National Oil Corp. 4,750 % éch. 03/04/2026	1 300	1 276	0,40
4,875 % éch. 03/04/2028	3 100	3 071	0,96
		19 258	6,02
Total Corée du Sud		42 741	13,36
SRI LANKA			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka 5,750 % éch. 18/04/2023 ^	500	228	0,07
6,200 % éch. 11/05/2027 ^	1 400	645	0,20
6,350 % éch. 28/06/2024 ^	500	230	0,07
6,825 % éch. 18/07/2026 ^	500	237	0,07
6,850 % éch. 14/03/2024 ^	600	276	0,09
6,850 % éch. 03/11/2025 ^	1 976	942	0,30
7,550 % éch. 28/03/2030 ^	1 100	506	0,16
Total Sri Lanka		3 064	0,96

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
THAÏLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Bangkok Bank PCL 4,300 % éch. 15/06/2027	\$ 1 800	\$ 1 750	0,55
Kasikornbank PCL 5,275 % éch. 14/10/2025 (e)(g)	1 100	1 040	0,33
5,458 % éch. 07/03/2028	2 700	2 703	0,84
Total Thaïlande		5 493	1,72
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Diamond Ltd. 7,950 % éch. 28/07/2026	600	591	0,18
HSBC Holdings PLC 8,000 % éch. 07/03/2028 (e)(g)	600	597	0,19
Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,500 % éch. 15/07/2028	€ 900	860	0,27
Prudential Funding Asia PLC 2,950 % éch. 03/11/2033	\$ 700	592	0,18
Standard Chartered PLC 0,991 % éch. 12/01/2025	1 200	1 164	0,36
1,822 % éch. 23/11/2025	1 400	1 310	0,41
3,603 % éch. 12/01/2033 (h)	500	401	0,13
6,000 % éch. 26/07/2025 (e)(g)	1 200	1 143	0,36
6,170 % éch. 09/01/2027	1 500	1 499	0,47
6,187 % éch. 06/07/2027 (a)	500	500	0,16
6,301 % éch. 09/01/2029	2 300	2 314	0,72
7,750 % éch. 15/08/2027 (e)(g)	2 100	2 085	0,65
Vedanta Resources Finance PLC 8,950 % éch. 11/03/2025	1 350	1 021	0,32
Total Royaume-Uni		14 077	4,40
ÉTATS-UNIS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Hyundai Capital America 2,750 % éch. 27/09/2026	700	637	0,20
Stillwater Mining Co. 4,000 % éch. 16/11/2026	800	715	0,22
		1 352	0,42
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/11/2051	600	396	0,12
2,250 % éch. 15/08/2049	20	15	0,01
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) 0,125 % éch. 15/01/2032	4 267	3 759	1,18
Billets du Trésor américain 3,250 % éch. 31/08/2024	6 100	5 954	1,86
		10 124	3,17
Total États-Unis		11 476	3,59
VIETNAM			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Vietnam Debt & Asset Trading Corp. 1,000 % éch. 10/10/2025	1 600	1 354	0,42
Obligation internationale du gouvernement vietnamien 5,500 % éch. 12/03/2028	1 950	1 882	0,59
Total Vietnam		3 236	1,01

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES			
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES			
ADM AG Holding Ltd. 0,000 % éch. 28/08/2023 (c)	\$ 1 000	\$ 990	0,31
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Celestial Miles Ltd. 7,750 % éch. 31/01/2024 (e)	1 600	1 580	0,49
Champion Path Holdings Ltd. 4,500 % éch. 27/01/2026	900	796	0,25
Easy Tactic Ltd. (6,500 % en numéraire ou 7,500 % de rémunération en nature) 7,500 % éch. 11/07/2027 (b)	700	60	0,02
7,500 % éch. 11/07/2028 (b)	3 400	255	0,08
NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % éch. 10/03/2028 (e)	3 550	2 412	0,75
4,800 % éch. 09/09/2023 (e)	400	236	0,07
5,250 % éch. 22/03/2026 (e)	1 600	1 410	0,44
Peak RE BVI Holding Ltd. 5,350 % éch. 28/10/2025 (e)	1 300	1 079	0,34
RKPF Overseas Ltd. 5,125 % éch. 26/07/2026	2 600	1 192	0,37
5,900 % éch. 05/03/2025	305	194	0,06
Studio City Finance Ltd. 5,000 % éch. 15/01/2029	1 100	816	0,26
6,000 % éch. 15/07/2025	1 100	1 022	0,32
TSMC Global Ltd. 1,750 % éch. 23/04/2028	1 800	1 551	0,49
Wanda Properties Global Co. Ltd. 11,000 % éch. 20/01/2025	300	134	0,04
11,000 % éch. 13/02/2026	200	85	0,03
Wheelock MTN BVI Ltd. 2,375 % éch. 25/01/2026	1 500	1 381	0,43
		14 203	4,44
Total Îles Vierges britanniques		15 193	4,75
Total des valeurs mobilières	\$	281 696	88,08
ACTIONS			
FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISÉS DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	1 989 038	19 807	6,19
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (f)	1 880	25	0,01
		19 832	6,20
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	10 100	1 003	0,31
Total des Fonds d'investissement	\$	20 835	6,51

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
SSB	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 347	Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	\$ (354)	\$ 347	\$ 347	0,11
Total des contrats de mise en pension						\$ (354)	\$ 347	\$ 347	0,11

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Asia Strategic Interest 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 Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	6	\$ 10	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	3	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	4	(9)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	32	(94)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	33	68	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	175	(330)	(0,10)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	11	15	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	40	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	67	52	0,02
				\$ (286)	(0,09)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (286)	(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 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
Atlantia SpA	1,000 %	20/06/2025	€ 100	\$ 8	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20/06/2026	400	(22)	(0,01)
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20/06/2028	400	19	0,01
				\$ 5	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 recevoir ⁽³⁾	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,850 %	20/09/2033	¥ 450 000	\$ (26)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	15/06/2024	\$ 10 900	(35)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	14 400	332	0,10
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2033	KRW 5 041 456	(39)	(0,01)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,500	15/03/2028	4 761 600	27	0,01
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	0,500	16/12/2025	AUD 800	59	0,02
					\$ 318	0,10
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 323	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.

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 - 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
BOA	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	(1,000) %	20/06/2028	\$ 5 200	\$ (75)	\$ (27)	\$ (102)	(0,03)

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
BPS	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20/06/2026	\$ 600	\$ (10)	\$ (61)	\$ (71)	(0,03)
BRC	BOC Aviation Ltd.	1,000	20/06/2026	2 000	(7)	11	4	0,00
	Obligation internationale du gouvernement des Philippines	1,000	20/06/2028	2 400	11	9	20	0,01
CBK	Obligation internationale du gouvernement d'Indonésie	1,000	20/06/2028	9 600	51	12	63	0,02
	Obligation internationale du gouvernement du Vietnam	1,000	20/12/2027	1 400	(40)	37	(3)	0,00
					\$ 5	\$ 8	\$ 13	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 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
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,545 %	05/05/2028	MYR 15 644	\$ 0	\$ 18	\$ 18	0,01
GST	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	19 310	6	23	29	0,01
						\$ 6	\$ 41	\$ 47	0,02

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	08/2023	AUD	1 425	\$ 963	\$ 14	\$ 0	14	0,01	
	08/2023	CNY	1 082	158	8	0	8	0,00	
	08/2023	¥	451 300	3 160	17	0	17	0,01	
	09/2023	IDR	358 262	24	0	0	0	0,00	
	09/2023	TWD	15 282	503	12	0	12	0,01	
	09/2023	\$	98	HKD	762	0	0	0,00	
	09/2023	\$	1 761	INR	145 646	9	0	9	0,00
	07/2023	\$	4 019	€	3 668	0	(17)	(17)	(0,01)
	07/2023	\$	1 722	MYR	7 906	0	(25)	(25)	(0,01)
BPS	08/2023	CNY	1 273	\$ 186	10	0	10	0,00	
	08/2023	€	3 668	4 025	17	0	17	0,01	
	08/2023	TWD	7 649	251	5	0	5	0,00	
	08/2023	\$	774	CNH	5 348	0	(36)	(36)	(0,01)
	09/2023	THB	371	\$ 11	0	0	0	0,00	
	08/2023	\$	114	¥	15 085	0	(9)	(9)	0,00
	09/2023	PHP	93 068	\$ 1 661	0	(19)	(19)	(0,01)	
	07/2023	\$	170 959	3 134	43	0	43	0,01	
	08/2023	TWD	7 964	261	5	0	5	0,00	
DUB	09/2023	\$	1 645	INR	135 260	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	CNH	12 708	\$ 1 805	54	0	54	0,02	
	09/2023	\$	3 336	THB	115 103	0	(66)	(66)	(0,02)
	07/2023	€	15	\$ 16	0	0	0	0,00	
	07/2023	PHP	11 188	205	2	0	2	0,00	
	08/2023	CNH	9 498	1 355	45	0	45	0,02	
	08/2023	CNY	1 343	196	11	0	11	0,00	
	08/2023	\$	621	CNH	4 293	0	(29)	(29)	(0,01)
	09/2023	IDR	149 873	\$ 10	0	0	0	0,00	
MYI	09/2023	THB	806	24	1	0	1	0,00	
	09/2023	\$	2	IDR	26 413	0	0	0,00	
	07/2023	HKD	20	\$ 3	0	0	0	0,00	
	07/2023	IDR	94 440	6	0	0	0	0,00	
	07/2023	\$	13	€ 12	0	0	0	0,00	
	07/2023	\$	1	£ 1	0	0	0	0,00	
	07/2023	\$	6	IDR	94 440	0	0	0,00	
	08/2023	CNH	2 673	\$ 382	13	0	13	0,01	
	08/2023	TWD	8 456	279	7	0	7	0,00	
SCX	08/2023	\$	1 625	¥ 216 013	0	(122)	(122)	(0,04)	
	09/2023	IDR	94 522	\$ 6	0	0	0	0,00	
	09/2023	\$	11	IDR	168 118	0	0	0,00	
	07/2023	\$	1 727	MYR	7 936	0	(23)	(23)	(0,01)
	08/2023	CNH	15 880	\$ 2 313	124	0	124	0,04	
	08/2023	CNY	3 566	522	29	0	29	0,01	
	08/2023	TWD	177	6	0	0	0	0,00	
	08/2023	\$	296	CNH	2 035	0	(15)	(15)	0,00
	08/2023	\$	1 732	TWD	52 659	0	(41)	(41)	(0,01)
SOG	09/2023	THB	834	\$ 24	0	0	0	0,00	
	09/2023	TWD	12 770	419	8	0	8	0,00	
	09/2023	\$	1 773	IDR	26 360 654	0	(22)	(22)	(0,01)
	07/2023	€	3 668	\$ 3 946	0	(56)	(56)	(0,02)	
	08/2023	\$	750	¥ 99 487	0	(58)	(58)	(0,02)	
	08/2023	\$	228	CNH	1 580	0	(10)	(10)	0,00
	09/2023	SGD	4 587	\$ 3 432	33	0	33	0,01	
	09/2023	\$	1 667	INR	137 786	8	0	8	0,00
							\$ 475	\$ (549)	\$ (74)

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
AZD	07/2023	\$ 49	€ 45	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07/2023	€ 55	\$ 58	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 36 935	€ 34 365	558	0	558	0,18
CBK	07/2023	€ 37 057	\$ 40 259	1	(170)	(169)	(0,05)
	07/2023	\$ 126	€ 117	2	0	2	0,00
	08/2023	38 011	34 913	131	0	131	0,04
GLM	07/2023	2 093	1 959	45	0	45	0,01
MBC	07/2023	€ 652	\$ 715	3	0	3	0,00
	07/2023	\$ 37 987	€ 35 529	775	0	775	0,24
SCX	07/2023	37 030	34 602	721	0	721	0,23
UAG	07/2023	€ 92	\$ 100	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 2 236	\$ (172)	\$ 2 064	0,65

Au 30 juin 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
CBK	07/2023	\$ 29	£ 23	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
MBC	07/2023	117	94	3	0	3	0,00
MYI	07/2023	120	96	3	0	3	0,00
SCX	07/2023	31	25	1	0	1	0,00
UAG	07/2023	94	75	2	0	2	0,00
				\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00

Au 30 juin 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
GLM	07/2023	\$ 1 325	SGD 1 781	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	(0,01)
MBC	07/2023	2 038	2 754	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023	35	47	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	SGD 3 488	\$ 2 581	4	0	4	0,00
	08/2023	\$ 2 547	SGD 3 439	0	(4)	(4)	0,00
SCX	07/2023	2 149	2 909	0	0	0	0,00
UAG	07/2023	2 396	3 239	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 4	\$ (19)	\$ (15)	(0,01)

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 1 942 0,61

Total des Investissements

\$ 304 857 95,32

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 14 962 4,68

Actifs nets

\$ 319 819 100,00

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) Titres 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) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) 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	\$ 189	0,06
Standard Chartered PLC	3,603	12/01/2033	06/02/2023	432	401	0,13
				\$ 2 108	\$ 590	0,19

Un montant en numéraire de 2 463 \$ (31 décembre 2022 : 1 987 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2022 : 30 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 279 938	\$ 1 758	\$ 281 696
Fonds d'investissement	20 835	0	0	20 835
Contrats de mise en pension	0	347	0	347
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	5	1 974	0	1 979
Totaux	\$ 20 840	\$ 282 259	\$ 1 758	\$ 304 857

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	\$ 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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 515	\$ (590)	\$ (75)	\$ (103)	\$ 0	\$ (103)
BPS	(117)	0	(117)	(80)	0	(80)
BRC	(4)	0	(4)	(20)	30	10
CBK	71	0	71	917	(820)	97
DUB	54	0	54	77	0	77
GLM	(12)	0	(12)	61	(250)	(189)
GST	29	0	29	S/O	S/O	S/O
JPM	30	0	30	34	0	34
MBC	778	(740)	38	661	(670)	(9)
MYI	(99)	0	(99)	10	(129)	(119)
SCX	782	(690)	92	894	(680)	214
SOG	(56)	0	(56)	S/O	S/O	S/O
TOR	(58)	0	(58)	S/O	S/O	S/O
UAG	29	0	29	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	74,58	75,24
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	13,50	12,97
Fonds d'investissement	6,51	9,47
Contrats de mise en pension	0,11	0,26
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,09)	(0,05)
Instruments financiers dérivés compensés	0,10	0,11
Instruments financiers dérivés hors cote	0,61	0,78

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	1,75	2,17
Brésil	0,10	0,10
Îles Caïmans	15,62	17,23
Chine	3,95	4,71

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
France	0,53	0,56
Allemagne	0,49	0,68
Hong Kong	6,14	5,57
Inde	4,72	7,64
Indonésie	7,60	9,42
Irlande	0,99	S/O
Israël	S/O	0,15
Japon	2,22	2,19
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,41	0,38
Luxembourg	0,22	0,22
Malaisie	2,51	2,11
Île Maurice	3,16	4,60
Mexique	0,23	0,24
Mongolie	0,87	0,53
Pays-Bas	1,07	1,40
Pakistan	1,08	0,87
Philippines	1,69	1,62
Singapour	2,94	3,04
Corée du Sud	13,36	7,62
Sri Lanka	0,96	0,70
Thaïlande	1,72	2,83
Royaume-Uni	4,40	1,74
États-Unis	3,59	4,01
Vietnam	1,01	0,00
Îles Vierges britanniques	4,75	5,88
Fonds d'investissement	6,51	9,47
Contrats de mise en pension	0,11	0,26
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,09)	(0,05)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	(0,02)
Swaps de taux d'intérêt	0,10	0,13
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	(0,03)	(0,04)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	(0,04)
Swaps de taux d'intérêt	0,02	S/O
Contrats de change à terme	(0,02)	0,03
Contrats de change à terme couverts	0,64	0,83
Autres actifs et passifs à court terme	4,68	1,22
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Banco Santander S.A.			
3,625 % éch. 21/03/2029 (d)(f)	€ 36 200	\$ 26 089	0,48
4,125 % éch. 12/11/2027 (d)(f)(h)	50 800	41 650	0,76
4,375 % éch. 14/01/2026 (d)(f)	54 200	49 698	0,91
Bankinter S.A.			
6,250 % éch. 17/01/2026 (d)(f)	11 000	11 436	0,21
7,375 % éch. 15/08/2028 (d)(f)	8 600	8 902	0,16
CaixaBank S.A.			
3,625 % éch. 14/09/2028 (d)(f)	61 200	45 560	0,84
5,250 % éch. 23/03/2026 (d)(f)	11 600	10 734	0,20
5,875 % éch. 09/10/2027 (d)(f)	13 600	13 313	0,24
6,750 % éch. 13/06/2024 (d)(f)	72 000	76 250	1,40
8,250 % éch. 13/03/2029 (d)(f)	29 600	31 224	0,57
Total Espagne		451 517	8,28
SUÈDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Svenska Handelsbanken AB			
4,375 % éch. 01/03/2027 (d)(f)	\$ 40 000	33 973	0,63
4,750 % éch. 01/03/2031 (d)(f)	37 400	29 013	0,53
Swedbank AB			
4,000 % éch. 17/03/2029 (d)(f)	3 000	2 160	0,04
Total Suède		65 146	1,20
SUISSE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Credit Suisse AG			
0,250 % éch. 05/01/2026	€ 450	439	0,01
0,250 % éch. 01/09/2028	200	175	0,00
0,495 % éch. 02/02/2024	\$ 600	577	0,01
1,250 % éch. 07/08/2026	500	431	0,01
4,474 % éch. 01/09/2023	€ 800	872	0,02
4,713 % éch. 31/05/2024	950	1 033	0,02
4,750 % éch. 09/08/2024	\$ 250	244	0,00
5,000 % éch. 09/07/2027	1 100	1 063	0,02
7,500 % éch. 15/02/2028	550	585	0,01
7,750 % éch. 10/03/2026	€ 100	129	0,00
7,950 % éch. 09/01/2025	\$ 250	255	0,00
UBS AG			
5,125 % éch. 15/05/2024 (f)	5 000	4 924	0,09
UBS Group AG			
0,650 % éch. 14/01/2028	€ 800	751	0,01
0,650 % éch. 10/09/2029	100	86	0,00
1,000 % éch. 24/06/2027	200	194	0,00
1,250 % éch. 17/07/2025	250	261	0,01
2,125 % éch. 12/09/2025	€ 200	238	0,00
2,125 % éch. 13/10/2026	€ 200	203	0,00
2,125 % éch. 15/11/2029	€ 200	199	0,00
2,250 % éch. 09/06/2028	300	315	0,01
2,593 % éch. 11/09/2025	\$ 850	811	0,02
2,746 % éch. 11/02/2033 (h)	11 570	9 019	0,17
2,875 % éch. 02/04/2032	€ 1 200	1 143	0,02
3,091 % éch. 14/05/2032	\$ 4 500	3 642	0,07
3,250 % éch. 02/04/2026	€ 1 800	1 893	0,03
3,750 % éch. 26/03/2025	\$ 700	670	0,01
3,869 % éch. 12/01/2029	300	271	0,01
4,177 % éch. 16/01/2026	€ 1 850	1 988	0,04
4,194 % éch. 01/04/2031	\$ 36 000	32 061	0,59
4,282 % éch. 09/01/2028	300	278	0,01
4,375 % éch. 10/02/2031 (d)(f)(h)	37 135	26 252	0,48
4,375 % éch. 10/02/2031 (d)(f)	5 100	3 605	0,07
4,550 % éch. 17/04/2026	200	192	0,00
4,875 % éch. 12/02/2027 (d)(f)(h)	43 100	34 611	0,64
4,875 % éch. 12/02/2027 (d)(f)	42 500	34 130	0,63
5,959 % éch. 12/01/2034	6 100	6 072	0,11
6,373 % éch. 15/07/2026	850	845	0,02
6,442 % éch. 11/08/2028	2 500	2 511	0,05
6,537 % éch. 12/08/2033	1 050	1 076	0,02
7,000 % éch. 19/02/2025 (d)(f)	5 737	5 474	0,10
7,000 % éch. 30/09/2027	€ 600	752	0,01
7,375 % éch. 07/09/2033	900	1 199	0,02
7,750 % éch. 01/03/2029	€ 2 400	2 904	0,05
9,016 % éch. 15/11/2033	\$ 650	780	0,01
Total Suisse		185 153	3,40

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Barclays PLC			
2,894 % éch. 24/11/2032	\$ 200	\$ 158	0,00
6,125 % éch. 15/12/2025 (d)(f)	33 483	29 390	0,54
7,125 % éch. 15/06/2025 (d)(f)	€ 35 350	40 873	0,75
7,437 % éch. 02/11/2033 (h)	\$ 16 000	17 319	0,32
8,000 % éch. 15/06/2024 (d)(f)	€ 47 524	45 024	0,83
9,250 % éch. 15/09/2028 (d)(f)	€ 19 500	22 456	0,41
Bupa Finance PLC			
4,000 % éch. 24/09/2031 (d)(f)	6 800	5 148	0,09
HSBC Bank PLC			
5,460 % éch. 29/09/2023 (d)(h)	\$ 19 480	19 480	0,36
HSBC Holdings PLC			
2,804 % éch. 24/05/2032	200	162	0,00
5,875 % éch. 28/09/2026 (d)(f)	€ 200	222	0,00
6,000 % éch. 29/09/2023 (d)(f)	€ 36 831	39 985	0,73
6,000 % éch. 22/05/2027 (d)(f)	\$ 19 300	17 298	0,32
6,161 % éch. 09/03/2029	20 000	20 189	0,37
6,254 % éch. 09/03/2034	1 000	1 026	0,02
6,332 % éch. 09/03/2044	9 100	9 442	0,17
6,375 % éch. 30/03/2025 (d)(f)	5 000	4 795	0,09
8,000 % éch. 07/03/2028 (d)(f)(h)	35 400	35 232	0,65
Lloyds Banking Group PLC			
4,947 % éch. 27/06/2025 (d)(f)	€ 70 522	70 336	1,29
7,500 % éch. 27/06/2024 (d)(f)	\$ 15 800	15 107	0,28
7,500 % éch. 27/09/2025 (d)(f)	25 491	23 902	0,44
7,875 % éch. 27/06/2029 (d)(f)	€ 44 954	50 700	0,93
8,000 % éch. 27/09/2029 (d)(f)	\$ 43 280	39 651	0,73
8,500 % éch. 27/03/2027 (d)(f)	€ 16 900	20 227	0,37
8,500 % éch. 27/03/2028 (d)(f)	35 900	42 466	0,78
Nationwide Building Society			
5,750 % éch. 20/06/2027 (d)(f)	19 270	21 038	0,39
NatWest Group PLC			
4,445 % éch. 08/05/2030	\$ 33 800	31 099	0,57
4,500 % éch. 31/03/2028 (d)(f)	€ 18 200	17 476	0,32
4,600 % éch. 28/06/2031 (d)(f)	\$ 22 659	15 748	0,29
4,892 % éch. 18/05/2029	43 026	40 974	0,75
5,076 % éch. 27/01/2030 (h)	11 500	10 981	0,20
5,125 % éch. 12/05/2027 (d)(f)	€ 11 150	11 720	0,22
6,000 % éch. 29/12/2025 (d)(f)	\$ 69 400	64 368	1,18
8,000 % éch. 10/08/2025 (d)(f)	19 800	19 292	0,35
Santander UK Group Holdings PLC			
2,896 % éch. 15/03/2032	1 600	1 295	0,02
6,534 % éch. 10/01/2029	4 600	4 636	0,09
6,750 % éch. 24/06/2024 (d)(f)	€ 89 935	107 251	1,96
Santander UK PLC			
5,000 % éch. 07/11/2023	\$ 8 753	8 707	0,16
Standard Chartered PLC			
6,296 % éch. 06/07/2034 (a)	2 600	2 606	0,05
Virgin Money UK PLC			
8,250 % éch. 17/06/2027 (d)(f)	€ 20 000	21 482	0,39
9,250 % éch. 08/06/2024 (d)(f)	20 000	24 001	0,44
		973 262	17,85
ACTIONS			
TITRES PRIVILÉGIÉS			
Nationwide Building Society			
10,250 %	596 146	87 321	1,60
Total Royaume-Uni		1 060 583	19,45
ÉTATS-UNIS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Bank of America Corp.			
1,843 % éch. 04/02/2025 (h)	\$ 44 500	43 363	0,80
Credit Suisse AG			
AT1 Claim ^			
	254 548	10 182	0,19
Deutsche Postbank Funding Trust			
2,954 % éch. 02/12/2023 (d)	€ 1 704	1 303	0,02
3,125 % éch. 07/06/2024 (d)	12 980	9 929	0,18
Doctors Co. An Interinsurance Exchange			
4,500 % éch. 18/01/2032 (h)	\$ 3 400	2 699	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.			
3,000 % éch. 15/03/2024 (h)	7 500	7 343	0,13

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Liberty Mutual Group, Inc.			
3,625 % éch. 23/05/2059	€ 15 500	\$ 16 105	0,30
Morgan Stanley			
5,948 % éch. 19/01/2038	\$ 23 400	23 110	0,42
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.			
5,650 % éch. 01/05/2079 (h)	8 224	7 648	0,14
Total États-Unis		121 682	2,23
INSTRUMENTS A COURT TERME			
BILLETS A COURT TERME			
Federal Home Loan Bank			
5,100 % éch. 25/08/2023	104 700	104 701	1,92
5,120 % éch. 25/09/2023	143 100	143 111	2,63
		247 812	4,55
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
5,127 % éch. 12/09/2023 (b)(c)	62 500	61 867	1,13
5,139 % éch. 12/09/2023 (b)(c)	58 800	58 205	1,07
5,143 % éch. 12/09/2023 (b)(c)	140 800	139 375	2,56
5,150 % éch. 03/08/2023 (b)(c)	46 600	46 395	0,85
5,161 % éch. 08/08/2023 (b)(c)	2 800	2 786	0,05
5,183 % éch. 15/08/2023 (b)(c)	6 900	6 858	0,13
5,189 % éch. 10/08/2023 (b)(c)(i)	23 300	23 174	0,43
5,212 % éch. 08/08/2023 (b)(c)	14 000	13 928	0,26
5,221 % éch. 14/09/2023 (b)(c)	35 000	34 634	0,64
5,222 % éch. 10/08/2023 (b)(c)(i)	27 000	26 854	0,49
5,229 % éch. 22/08/2023 (b)(c)	98 400	97 695	1,79
5,233 % éch. 07/09/2023 (b)(c)	18 400	18 227	0,33
5,241 % éch. 17/08/2023 (a)(b)(c)	23 800	23 647	0,43
5,245 % éch. 17/08/2023 (a)(b)(c)	54 900	54 546	1,00
5,256 % éch. 17/08/2023 (a)(b)(c)	16 200	16 095	0,30
5,313 % éch. 24/08/2023 (b)(c)	25 200	25 012	0,46
5,327 % éch. 19/09/2023 (b)(c)(i)	10 300	10 185	0,19
5,335 % éch. 24/08/2023 (b)(c)	19 500	19 354	0,35
5,370 % éch. 31/08/2023 (b)(c)(i)	16 200	16 063	0,29
5,382 % éch. 19/09/2023 (b)(c)(i)	10 600	10 481	0,19
5,406 % éch. 26/09/2023 (b)(c)	21 200	20 943	0,38
5,421 % éch. 26/09/2023 (b)(c)	30 800	30 427	0,56
		756 751	13,88
Total des instruments à court terme		1 004 563	18,43
Total des valeurs mobilières			
		\$ 5 571 381	102,22
ACTIONS			
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc -			
Fonds PIMCO US Dollar			
Short-Term Floating			
NAV Fund (e)			
	14 302	142	0,00
Total des Fonds d'investissement		\$ 142	0,00

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
NOM	5,040 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 25 100	Obligations du Trésor américain 2,500 % échéance 15/05/2046	\$ (25 876)	\$ 25 100	\$ 25 111	0,46
Total des contrats de mise en pension						\$ (25 876)	\$ 25 100	\$ 25 111	0,46

⁽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 septembre	Long	09/2023	222	\$ (300)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	442	460	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Long	09/2023	1 252	(1 663)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	432	(997)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Court	09/2023	1 456	1 606	0,03
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Long	09/2023	371	(356)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	4 949	(13 643)	(0,25)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	523	617	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	3 545	(5 789)	(0,10)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	1 403	1 699	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	455	776	0,02
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Long	09/2023	422	(444)	(0,01)
				\$ (18 034)	(0,33)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (18 034)	(0,33)

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 %	20/06/2027	€ 20 000	\$ 1 279	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	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,750 %	15/09/2051	£ 3 800	\$ 1 439	0,03
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250	20/09/2053	31 100	2 055	0,04
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	93 100	6 895	0,13
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	43 900	3 107	0,06
À payer ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	21 100	(778)	(0,02)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	€ 64 900	(373)	(0,01)
					\$ 12 345	0,23
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 13 624	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.

Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities 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.

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	07/2023	\$	AUD 124	187	\$ 0	\$ 0	0,00	
	08/2023	AUD	\$ 187	124	0	0	0,00	
BOA	07/2023	CAD	20 676	15 195	0	(430)	(0,01)	
	07/2023	€	258 345	277 698	5	(4 162)	(0,07)	
	07/2023	SEK	95	9	0	0	0,00	
	07/2023	\$	10 737	9 927	93	0	0,00	
	07/2023		3 135	2 484	23	0	0,00	
	08/2023		49	335	0	(2)	(0,00)	
BPS	07/2023	AUD	70	46	0	(1)	(0,00)	
	07/2023	€	1 719 265	1 848 252	0	(27 468)	(0,50)	
	07/2023	£	1 847	2 284	0	(64)	(0,00)	
	07/2023	\$	89	134	0	0	0,00	
	07/2023		39 386	36 578	554	(34)	0,01	
	08/2023	AUD	134	89	0	0	0,00	
	08/2023	\$	58	394	0	(3)	(0,00)	
BRC	07/2023	£	28 263	35 167	0	(765)	(0,01)	
	07/2023	\$	21 176	16 634	0	(28)	(0,00)	
CBK	07/2023	€	23 520	25 351	14	(323)	(0,01)	
	07/2023	£	4 999	6 309	0	(47)	(0,00)	
	07/2023	\$	307 242	282 810	1 305	0	0,03	
	07/2023		20 507	16 126	7	(12)	(0,00)	
	08/2023	CNH	268	38	1	0	0,00	
	08/2023	€	254 332	276 900	0	(956)	(0,02)	
DUB	07/2023	AUD	446	307	10	0	0,00	
JPM	07/2023	€	6 538	6 990	0	(143)	(0,00)	
	07/2023	SGD	1 765	1 336	31	0	0,00	
	07/2023	\$	1 804 057	1 652 218	0	(1 486)	(0,03)	
	07/2023		571 634	452 099	3 143	0	0,06	
	08/2023	€	1 652 218	1 806 580	1 541	0	0,03	
	08/2023	£	452 099	571 755	0	(3 136)	(0,06)	
	08/2023	\$	61	415	0	(3)	(0,00)	
MBC	07/2023	CAD	716	528	0	(13)	(0,00)	
	07/2023	€	6 910	7 394	0	(144)	(0,00)	
	07/2023	£	328 949	407 242	0	(10 968)	(0,20)	
	07/2023	\$	28 387	26 125	197	(82)	0,00	
	07/2023		1 259	985	0	(7)	(0,00)	
MYI	07/2023	€	1 493	1 636	7	0	0,00	
	07/2023	£	130 807	162 576	0	(3 726)	(0,07)	
	07/2023	SEK	4 786	446	3	0	0,00	
	07/2023	\$	38 345	35 336	206	0	0,00	
	07/2023		5 069	4 072	108	0	0,00	
	07/2023		453	4 888	0	0	0,00	
	08/2023	SEK	4 882	453	0	0	0,00	
RBC	07/2023	£	164	210	1	0	0,00	
SCX	07/2023	\$	182	275	0	0	0,00	
	08/2023	AUD	275	183	0	(1)	(0,00)	
	08/2023	\$	42	290	0	(2)	(0,00)	
SOG	07/2023	AUD	296	194	0	(3)	(0,00)	
TOR	07/2023	\$	223	338	2	0	0,00	
	07/2023		16 168	21 393	11	(12)	(0,00)	
	08/2023	AUD	338	224	0	(2)	(0,00)	
	08/2023	CAD	21 385	16 168	12	(11)	0,00	
UAG	07/2023	AUD	306	200	0	(3)	(0,00)	
	07/2023	€	26 170	28 016	0	(536)	(0,01)	
	07/2023	\$	108	163	1	0	0,00	
	08/2023	AUD	163	108	0	(1)	(0,00)	
	09/2023	\$	15	21	0	0	0,00	
					\$ 7 275	\$ (54 574)	\$ (47 299)	(0,86)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en AUD (couverte) de distribution et 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	07/2023	AUD	\$ 5 006	\$ 3 322	\$ 0	\$ (10)	0,00
	07/2023	\$	6 073	AUD 9 279	104	0	0,00
	08/2023		3 325	5 006	10	0	0,00
BOA	07/2023	AUD	425	\$ 286	4	0	0,00
	07/2023	\$	12 486	AUD 19 198	293	0	0,01
BPS	07/2023	AUD	26 037	\$ 17 248	0	(84)	(0,00)
	07/2023	\$	370	AUD 567	7	0	0,00
	08/2023		16 984	25 620	84	0	0,00
CBK	07/2023	AUD	817	\$ 556	12	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
JPM	07/2023	\$ 4 143	AUD 6 350	\$ 84	\$ 0	\$ 84	0,00
MBC	07/2023	6 307	9 647	115	0	115	0,00
RBC	07/2023	AUD 193	\$ 128	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2023	127	87	2	0	2	0,00
	07/2023	8 831	5 863	0	(16)	(16)	0,00
	07/2023	\$ 5 029	AUD 7 696	94	0	94	0,00
	08/2023	5 867	8 831	16	0	16	0,00
SOG	07/2023	10 043	15 350	175	0	175	0,00
TOR	07/2023	AUD 15 420	\$ 10 185	0	(79)	(79)	0,00
	07/2023	\$ 10 670	AUD 16 314	189	0	189	0,01
	08/2023	10 193	15 420	79	0	79	0,00
UAG	07/2023	AUD 29 991	\$ 19 917	41	(87)	(46)	0,00
	07/2023	\$ 4 861	AUD 7 426	82	0	82	0,00
	08/2023	19 744	29 713	88	(38)	50	0,00
				\$ 1 479	\$ (315)	\$ 1 164	0,02

Au 30 juin 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	07/2023	BRL 162	\$ 32	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BPS	07/2023	21 681	4 538	44	(1)	43	0,00
	07/2023	\$ 32	BRL 152	0	0	0	0,00
	08/2023	BRL 478	\$ 100	1	0	1	0,00
	08/2023	\$ 4 105	BRL 19 713	0	(39)	(39)	0,00
CBK	07/2023	BRL 20 452	\$ 4 277	37	0	37	0,00
	07/2023	\$ 4 488	BRL 22 477	171	0	171	0,00
	08/2023	4 255	20 452	0	(36)	(36)	0,00
GLM	07/2023	4 783	23 958	184	0	184	0,01
JPM	07/2023	BRL 8 794	\$ 1 812	7	(18)	(11)	0,00
	07/2023	\$ 4 844	BRL 24 248	183	0	183	0,00
	08/2023	BRL 76	\$ 16	0	0	0	0,00
TOR	07/2023	19 748	4 116	23	0	23	0,00
	08/2023	\$ 4 095	BRL 19 748	0	(21)	(21)	0,00
				\$ 650	\$ (116)	\$ 534	0,01

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$ 975	CAD 1 326	\$ 27	\$ 0	\$ 27	0,00
CBK	07/2023	957	1 304	28	0	28	0,00
MBC	07/2023	28	38	1	0	1	0,00
MYI	07/2023	CAD 43	\$ 32	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	\$ 980	CAD 1 332	26	0	26	0,00
				\$ 82	\$ 0	\$ 82	0,00

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	CHF 88	\$ 98	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 659	CHF 590	1	0	1	0,00
BPS	07/2023	CHF 14 388	\$ 16 087	5	0	5	0,00
	07/2023	\$ 20 651	CHF 18 681	229	0	229	0,01
	08/2023	16 016	14 283	0	(5)	(5)	0,00
CLY	07/2023	CHF 7 571	\$ 8 428	0	(34)	(34)	0,00
	08/2023	\$ 8 428	CHF 7 549	34	0	34	0,00
JPM	07/2023	CHF 314	\$ 348	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07/2023	201	224	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 22	CHF 20	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	CHF 57	\$ 63	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 350	CHF 317	4	0	4	0,00
RYL	07/2023	CHF 11	\$ 12	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	181	199	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$ 15 535	CHF 13 958	67	0	67	0,00
UAG	07/2023	CHF 14 805	\$ 16 516	0	(33)	(33)	0,00
	07/2023	\$ 14 216	CHF 12 773	61	0	61	0,00
	08/2023	16 516	14 763	33	0	33	0,00
				\$ 434	\$ (80)	\$ 354	0,01

Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 450	\$ 491	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2023	\$ 793 672	€ 738 470	12 000	0	12 000	0,22
BPS	07/2023	€ 728 477	\$ 798 180	3 413	(2)	3 411	0,06
	07/2023	\$ 787 788	€ 732 820	11 721	0	11 721	0,21
	08/2023	795 650	725 139	0	(3 442)	(3 442)	(0,06)
CBK	07/2023	€ 727 517	\$ 790 962	0	(2 760)	(2 760)	(0,05)
	07/2023	\$ 13 694	€ 12 758	224	0	224	0,00
	08/2023	790 649	726 210	2 731	0	2 731	0,05
JPM	07/2023	€ 726 210	\$ 792 948	653	0	653	0,01
	08/2023	\$ 794 057	€ 726 210	0	(677)	(677)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 23 655	\$ 25 597	28	(239)	(211)	0,00
	07/2023	\$ 3 667	€ 3 429	73	0	73	0,00
SOG	07/2023	788 324	732 820	11 184	0	11 184	0,21
				\$ 42 028	\$ (7 120)	\$ 34 908	0,64

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 155	£ 123	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	07/2023	£ 348	\$ 437	2	(7)	(5)	0,00
	07/2023	\$ 51 481	£ 41 622	1 435	0	1 435	0,02
BRC	07/2023	£ 161	\$ 204	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 348	£ 274	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	£ 266	\$ 336	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$ 117	£ 93	1	0	1	0,00
JPM	07/2023	£ 41 953	\$ 53 046	0	(292)	(292)	(0,01)
	08/2023	\$ 53 057	£ 41 953	291	0	291	0,01
MBC	07/2023	53 170	42 946	1 430	0	1 430	0,03
MYI	07/2023	52 413	42 171	1 202	0	1 202	0,02
TOR	07/2023	£ 41 982	\$ 53 346	0	(27)	(27)	0,00
	08/2023	\$ 53 358	£ 41 982	26	0	26	0,00
				\$ 4 388	\$ (329)	\$ 4 059	0,07

Au 30 juin 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
BRC	07/2023	\$ 24 236	SGD 32 795	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
GLM	07/2023	SGD 320	\$ 238	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 340	SGD 457	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07/2023	SGD 31 840	\$ 23 529	3	0	3	0,00
	07/2023	\$ 2 141	SGD 2 898	0	0	0	0,00
	08/2023	23 529	31 809	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07/2023	22 109	29 872	0	(37)	(37)	0,00
	08/2023	SGD 292	\$ 216	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	31 368	23 214	37	(1)	36	0,00
	08/2023	\$ 22 780	SGD 30 752	0	(34)	(34)	0,00
UAG	07/2023	SGD 249	\$ 184	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 23 857	SGD 32 273	0	(10)	(10)	0,00
				\$ 41	\$ (91)	\$ (50)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ (6 248)	(0,11)
Total des Investissements						\$ 5 585 965	102,49
Autres actifs et passifs à court terme						\$ (135 963)	(2,49)
Actifs nets						\$ 5 450 002	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) Titres 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
Bank of Nova Scotia	3,625 %	27/10/2081	29/09/2021	\$ 19 200	\$ 13 587	0,25
Deutsche Bank AG	3,729	14/01/2032	17/10/2022 - 24/01/2023	10 466	10 198	0,19
				\$ 29 666	\$ 23 785	0,44

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 290 514 \$ (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 30 juin 2023.

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 9 837 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 12 150 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 8 540 \$ (31 décembre 2022 : 18 271 \$) 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 62 214 \$ (31 décembre 2022 : 80 890 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 5 570 373	\$ 1 008	\$ 5 571 381
Fonds d'investissement	142	0	0	142
Contrats de mise en pension	0	25 100	0	25 100
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(1 694)	(8 964)	0	(10 658)
Totaux	\$ (1 552)	\$ 5 586 509	\$ 1 008	\$ 5 585 965

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 30 juin 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 %	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (6 429)	\$ (7 048)	(0,13)
	5,480	23/05/2023	07/07/2023	\$ (30 710)	(30 892)	(0,57)
BRC	3,450	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (4 445)	(4 872)	(0,09)
	5,050	22/03/2023	06/07/2023	\$ (25 517)	(25 878)	(0,47)
JML	5,590	06/01/2023	06/07/2023	(61 405)	(62 975)	(1,15)
	5,590	02/03/2023	06/07/2023	(12 164)	(12 383)	(0,23)
	5,590	08/03/2023	06/07/2023	(12 726)	(12 945)	(0,24)
	5,590	22/03/2023	06/07/2023	(3 676)	(3 732)	(0,07)
NOM	4,250	08/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(4 738)	(4 768)	(0,09)
SCX	5,270	10/04/2023	10/07/2023	(34 615)	(35 030)	(0,64)
	5,270	15/06/2023	10/07/2023	(36 339)	(36 425)	(0,67)
	5,340	10/04/2023	10/07/2023	(16 238)	(16 435)	(0,30)
Total des contrats de prise en pension				\$ (253 383)	(4,65)	

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 104	\$ (80)	\$ 24	\$ 137	\$ 0	\$ 137
BOA	7 853	(5 909)	1 944	1 028	(1 010)	18
BPS	(13 655)	12 150	(1 505)	(1 308)	1 490	182
BRC	(798)	709	(89)	37	(10)	27
CBK	479	(300)	179	6 857	(6 830)	27
DUB	10	0	10	S/O	S/O	S/O
GLM	182	0	182	352	(400)	(48)
GST	S/O	S/O	S/O	(268)	262	(6)
JPM	206	(290)	(84)	175	(340)	(165)
MBC	(9 762)	7 291	(2 471)	14 804	(13 250)	1 554
MYI	(2 195)	1 516	(679)	771	(650)	121
RBC	3	0	3	34	0	34
SCX	181	(290)	(109)	(28 111)	26 890	(1 221)
SOG	11 356	(8 370)	2 986	S/O	S/O	S/O
TOR	190	(280)	(90)	(140)	1 350	1 210
UAG	(402)	321	(81)	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	84,71	82,69
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	17,32	24,44
Autres valeurs mobilières	0,19	S/O
Fonds d'investissement	0,00	0,00
Contrats de mise en pension	0,46	0,18
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,33)	0,42
Instruments financiers dérivés compensés	0,25	0,05
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,11)	(0,10)
Contrats de prise en pension	(4,65)	(10,11)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Autriche	1,50	1,85
Belgique	1,42	1,41
Canada	1,23	1,20
Îles Caïmans	S/O	0,11
Chine	S/O	0,01
Danemark	0,47	0,44
Finlande	0,80	0,82
France	12,35	13,26
Allemagne	2,55	3,81
Hong Kong	0,19	0,12
Irlande	3,38	3,56
Israël	S/O	0,26
Italie	7,11	7,66
Jersey, Îles Anglo-normandes	1,65	1,51
Luxembourg	0,13	0,64
Mexique	S/O	0,71
Pays-Bas	15,08	15,07
Norvège	0,47	0,36
Portugal	0,28	0,16
Slovénie	0,62	0,60
Espagne	8,28	8,65
Suède	1,20	0,72
Suisse	3,40	7,67
Royaume-Uni	19,45	18,81
États-Unis	2,23	1,51
Instruments à court terme	18,43	16,21
Fonds d'investissement	0,00	0,00
Contrats de mise en pension	0,46	0,18
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,33)	0,42
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,02	(0,03)
Swaps de taux d'intérêt	0,23	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	(0,86)	(1,11)
Contrats de change à terme couverts	0,75	1,05
Autres actifs et passifs à court terme	(2,49)	(7,68)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES			
AUSTRALIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
GPT Wholesale Office Fund 3,222 % éch. 05/11/2031	AUD 500	\$ 259	0,09
Lendlease Finance Ltd. 3,400 % éch. 27/10/2027	930	544	0,19
3,700 % éch. 31/03/2031	200	104	0,03
Total Australie		907	0,31
AUTRICHE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Erste Group Bank AG 0,125 % éch. 17/05/2028	€ 700	631	0,22
UniCredit Bank Austria AG 3,125 % éch. 21/09/2029	600	645	0,22
Total Autriche		1 276	0,44
BELGIQUE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement belge 2,750 % éch. 22/04/2039	700	714	0,25
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 3,250 % éch. 12/01/2043	500	518	0,18
Total Belgique		1 232	0,43
CANADA			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Brookfield Property Finance ULC 7,125 % éch. 13/02/2028 (e)	CAD 700	490	0,17
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement canadien 2,250 % éch. 01/12/2029	6 400	4 521	1,56
Total Canada		5 011	1,73
CHILI			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement chilien 0,830 % éch. 02/07/2031	€ 2 100	1 808	0,63
3,500 % éch. 15/04/2053	\$ 400	299	0,10
Total Chili		2 107	0,73
CHYPRE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Atrium Finance PLC 2,625 % éch. 05/09/2027	€ 1 100	875	0,30
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,750 % éch. 20/06/2028	600	648	0,22
DANEMARK			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Danske Bank A/S 4,750 % éch. 21/06/2030	700	762	0,26
Pandora A/S 4,500 % éch. 10/04/2028	400	435	0,15
TDC Net A/S 5,618 % éch. 06/02/2030	1 900	2 036	0,71
Total Danemark		3 233	1,12
FINLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Nokia Oyj 4,375 % éch. 21/08/2031	500	538	0,18
Nordea Bank Abp 6,000 % éch. 02/06/2026	£ 1 800	2 249	0,78
Tornator Oyj 1,250 % éch. 14/10/2026	€ 200	197	0,07
		2 984	1,03

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Kuntarahoitus Oyj 3,000 % éch. 25/09/2028	€ 500	\$ 540	0,19
Total Finlande		3 524	1,22
FRANCE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AXA S.A. 5,500 % éch. 11/07/2043	400	437	0,15
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 0,250 % éch. 29/06/2028	100	91	0,03
BNP Paribas S.A. 0,500 % éch. 04/06/2026	2 900	2 945	1,02
1,675 % éch. 30/06/2027	\$ 500	441	0,15
4,625 % éch. 25/02/2031 (c)(d)	1 000	716	0,25
CNP Assurances 2,000 % éch. 27/07/2050	€ 200	174	0,06
4,875 % éch. 07/10/2030 (c)(d)	\$ 800	598	0,21
Crédit Agricole S.A. 0,125 % éch. 09/12/2027	€ 100	92	0,03
Forvia 2,750 % éch. 15/02/2027	500	496	0,17
Île-de-France Mobilités 0,400 % éch. 28/05/2031	800	705	0,24
Schneider Electric SE 3,250 % éch. 12/06/2028	1 200	1 294	0,45
SEB S.A. 1,375 % éch. 16/06/2025	600	619	0,21
Société Générale S.A. 0,625 % éch. 02/12/2027	1 200	1 135	0,39
		9 743	3,36
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Agence Française de Développement 1,375 % éch. 17/09/2024	1 000	1 061	0,37
3,500 % éch. 25/02/2033	800	888	0,31
Obligation internationale du gouvernement français 0,500 % éch. 25/06/2044	850	550	0,19
Régie Autonome des Transports Parisiens 3,250 % éch. 11/04/2033	1 400	1 514	0,52
Région d'Île de France 3,050 % éch. 03/02/2033	200	215	0,07
Société Du Grand Paris EPIC 0,300 % éch. 25/11/2031	1 900	1 623	0,56
1,000 % éch. 18/02/2070	100	45	0,02
3,500 % éch. 25/05/2043	500	531	0,18
Société Nationale SNCF S.A. 0,625 % éch. 17/04/2030	800	730	0,25
3,125 % éch. 02/11/2027	900	968	0,34
3,375 % éch. 25/05/2033	800	874	0,30
		8 999	3,11
Total France		18 742	6,47
ALLEMAGNE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Amprion GmbH 3,450 % éch. 22/09/2027	200	214	0,07
Commerzbank AG 3,000 % éch. 14/09/2027	500	512	0,18
3,375 % éch. 12/12/2025	700	757	0,26
Deutsche Bahn Finance GmbH 0,625 % éch. 08/12/2050	50	28	0,01
3,250 % éch. 19/05/2033	600	645	0,22
Deutsche Bank AG 1,875 % éch. 23/02/2028	1 900	1 837	0,64
E.ON SE 3,875 % éch. 12/01/2035	500	543	0,19
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % éch. 15/09/2028 (b)	100	93	0,03
1,375 % éch. 07/06/2032	15 600	14 979	5,17
2,000 % éch. 15/11/2029	10 400	10 702	3,70
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 1,000 % éch. 26/05/2042	700	552	0,19

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Schaeffler AG 3,375 % éch. 12/10/2028	€ 1 700	\$ 1 696	0,59
Vonovia SE 2,375 % éch. 25/03/2032	1 600	1 424	0,49
ZF Finance GmbH 2,000 % éch. 06/05/2027	800	762	0,26
2,250 % éch. 03/05/2028	600	553	0,19
		35 297	12,19
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
République d'Allemagne 0,000 % éch. 15/08/2031 (b)	1 400	1 266	0,43
État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie 0,000 % éch. 12/10/2035 (b)	20	15	0,01
		1 281	0,44
Total Allemagne		36 578	12,63
HONG KONG			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong 5,250 % éch. 11/01/2053	\$ 700	783	0,27
INDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % éch. 18/05/2031	1 176	993	0,34
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027	837	785	0,27
ReNew Wind Energy AP2 4,500 % éch. 14/07/2028	1 700	1 450	0,50
Total Inde		3 228	1,11
IRLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AIB Group PLC 2,875 % éch. 30/05/2031	€ 600	594	0,21
4,625 % éch. 23/07/2029	1 300	1 394	0,48
Bank of Ireland Group PLC 5,000 % éch. 04/07/2031 (a)	400	436	0,15
6,253 % éch. 16/09/2026	£ 800	795	0,27
7,594 % éch. 06/12/2032	\$ 600	731	0,25
Smurfit Kappa Treasury ULC 0,500 % éch. 22/09/2029	€ 1 000	885	0,31
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 3,000 % éch. 19/04/2051	\$ 650	510	0,18
3,500 % éch. 02/05/2052	1 200	956	0,33
Total Irlande		6 301	2,18
ITALIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Ferrovie dello Stato Italiane SpA 3,750 % éch. 14/04/2027	€ 1 200	1 288	0,44
UniCredit SpA 5,850 % éch. 15/11/2027	2 200	2 459	0,85
		3 747	1,29
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,500 % éch. 30/04/2045	1 050	709	0,25
4,000 % éch. 30/10/2031	400	440	0,15
		1 149	0,40
Total Italie		4 896	1,69
JAPON			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,848 % éch. 19/07/2029	800	739	0,26
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % éch. 05/09/2027	1 300	1 380	0,48
Norinchukin Bank 2,080 % éch. 22/09/2031	\$ 1 000	804	0,28
4,867 % éch. 14/09/2027	600	591	0,20

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			
NTT Finance Corp. 0,399 % éch. 13/12/2028	€ 1 300	\$ 1 199	0,41	CTP NV 1,250 % éch. 21/06/2029	€ 2 000	\$ 1 585	0,55	Caja Rural de Navarra SCC 3,000 % éch. 26/04/2027	€ 2 100	\$ 2 230	0,77			
4,239 % éch. 25/07/2025	\$ 2 900	2 822	0,98	Digital Intrepid Holding BV 0,625 % éch. 15/07/2031	1 500	1 139	0,39			5 845	2,02			
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % éch. 14/01/2029	1 300	1 110	0,38	DSV Finance BV 0,500 % éch. 03/03/2031	500	430	0,15	ÉMISSIONS SOUVERAINES						
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2,800 % éch. 10/03/2027	800	736	0,25	EnBW International Finance BV 3,625 % éch. 22/11/2026	500	542	0,19	Communauté autonome de Madrid 3,596 % éch. 30/04/2033	300	328	0,11			
		9 381	3,24	Enel Finance International NV 0,000 % éch. 17/06/2027				Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,000 % éch. 30/07/2042	1 700	1 170	0,40			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				(b)	600	563	0,19	Xunta de Galicia 0,084 % éch. 30/07/2027	50	47	0,02			
Japan Finance Organization for Municipalities 0,010 % éch. 02/02/2028	€ 400	372	0,13	1,375 % éch. 12/07/2026	\$ 1 000	883	0,31			1 545	0,53			
3,375 % éch. 22/02/2028	500	540	0,18	7,500 % éch. 14/10/2032	500	555	0,19	Total Espagne		7 390	2,55			
		912	0,31	ING Groep NV 1,125 % éch. 07/12/2028	£ 200	200	0,07	SUPRANATIONALES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS						
Total Japon		10 293	3,55	4,875 % éch. 16/05/2029	\$ 2 000	1 554	0,54	Eurofima Europäische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0,000 % éch. 28/07/2026						
JERSEY, ÎLES ANGLONORMANDES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				(c)(d)				(b)						
Aptiv PLC 3,100 % éch. 01/12/2051	\$ 200	126	0,05	JDE Peet's NV 2,250 % éch. 24/09/2031	1 000	775	0,27	0,010 % éch. 23/06/2028	2 000	1 849	0,64			
4,350 % éch. 15/03/2029	1 000	961	0,33	LeasePlan Corp. NV 0,250 % éch. 23/02/2026	€ 2 000	1 957	0,68	0,150 % éch. 10/10/2034	500	392	0,14			
		1 087	0,38	0,250 % éch. 07/09/2026	1 400	1 345	0,46	3,125 % éch. 09/11/2031	800	868	0,30			
LUXEMBOURG OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Nationale-Nederlanden Bank NV 0,500 % éch. 21/09/2028	1 100	995	0,34	Banque européenne d'investissement 0,750 % éch. 15/07/2027	AUD 500	287	0,10			
Acef Holding S.C.A. 0,750 % éch. 14/06/2028	€ 1 600	1 430	0,49	1,875 % éch. 17/05/2032	200	195	0,07	1,500 % éch. 15/06/2032	€ 5 600	5 389	1,86			
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % éch. 27/01/2028	1 200	1 036	0,36	NE Property BV 2,000 % éch. 20/01/2030	1 400	1 130	0,39	2,250 % éch. 15/03/2030	1 230	1 278	0,44			
0,900 % éch. 12/10/2029	1 000	799	0,28	Sika Capital BV 3,750 % éch. 03/11/2026	400	434	0,15	3,750 % éch. 14/02/2033	\$ 5 000	4 929	1,70			
CPI Property Group S.A. 1,750 % éch. 14/01/2030	600	397	0,14	TenneT Holding BV 4,500 % éch. 28/10/2034	700	815	0,28	Union européenne 0,000 % éch. 04/10/2030	€ 1 400	1 233	0,43			
2,750 % éch. 22/01/2028	£ 400	341	0,12	Thermo Fisher Scientific Finance BV 0,000 % éch. 18/11/2025	1 400	1 393	0,48	(b)						
Logicor Financing SARL 2,000 % éch. 17/01/2034	€ 1 100	798	0,27	VIA Outlets BV 1,750 % éch. 15/11/2028	1 100	965	0,33	0,300 % éch. 04/11/2050	100	53	0,02			
Prologis International Funding S.A. 0,750 % éch. 23/03/2033	475	353	0,12	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % éch. 03/12/2027	1 900	1 802	0,62	0,400 % éch. 04/02/2037	800	611	0,21			
0,875 % éch. 09/07/2029	125	109	0,04					2,625 % éch. 04/02/2048	600	592	0,20			
1,625 % éch. 17/06/2032	1 425	1 188	0,41	ÉMISSIONS SOUVERAINES				2,750 % éch. 04/02/2033	600	640	0,22			
3,625 % éch. 07/03/2030	200	204	0,07	Nederlandse Waterschapsbank NV 3,000 % éch. 20/04/2033	900	974	0,34	Banque internationale pour la reconstruction et le développement 2,125 % éch. 03/03/2025	\$ 1 000	953	0,33			
Segro Capital SARL 0,500 % éch. 22/09/2031	1 000	781	0,27	Total Pays-Bas		24 029	8,30	Association internationale de développement 0,750 % éch. 21/09/2028	£ 1 450	1 468	0,51			
SELP Finance SARL 0,875 % éch. 27/05/2029	1 500	1 280	0,44	NORVÈGE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Supranationales		20 640	7,13			
		8 716	3,01	DNB Bank ASA 3,625 % éch. 16/02/2027	1 700	1 817	0,63	SUÈDE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS						
ÎLE MAURICE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				SINGAPOUR OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Castellum AB 0,750 % éch. 04/09/2026				€ 1 100	989	0,34
India Green Power Holdings 4,000 % éch. 22/02/2027	\$ 400	350	0,12	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. 4,250 % éch. 25/03/2027	\$ 651	572	0,20	EQT AB 0,875 % éch. 14/05/2031	1 200	934	0,32			
MEXIQUE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				CORÉE DU SUD OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,000 % éch. 09/11/2026				300	323	0,11
Nemak S.A.B. de C.V. 2,250 % éch. 20/07/2028	€ 1 000	888	0,31	SK Hynix, Inc. 2,375 % éch. 19/01/2031	300	232	0,08			2 246	0,77			
MULTINATIONALES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				6,375 % éch. 17/01/2028	700	703	0,24	ÉMISSIONS SOUVERAINES						
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2,000 % éch. 01/09/2028	500	455	0,16	ÉMISSIONS SOUVERAINES				Kommuninvest Sverige AB 3,375 % éch. 15/03/2027	200	219	0,08			
3,000 % éch. 01/09/2029	150	122	0,04	Korea Water Resources Corp. 3,500 % éch. 27/04/2025	700	675	0,24	Svensk Exportkredit AB 2,000 % éch. 30/06/2027	1 100	1 135	0,39			
NXP BV 2,500 % éch. 11/05/2031	\$ 1 200	979	0,34	Total Corée du Sud		1 610	0,56			1 354	0,47			
		1 556	0,54	ESPAGNE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				ROYAUME-UNI OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS						
PAYS-BAS OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Banco Santander S.A. 0,625 % éch. 24/06/2029	€ 900	815	0,28	Assura Financing PLC 1,625 % éch. 30/06/2033	£ 1 100	918	0,32			
ABN AMRO Bank NV 2,470 % éch. 13/12/2029	2 400	2 012	0,69	CaixaBank S.A. 0,500 % éch. 09/02/2029	100	91	0,03	Berkeley Group PLC 2,500 % éch. 11/08/2031	1 300	1 081	0,37			
5,250 % éch. 26/05/2026	£ 400	492	0,17	1,500 % éch. 03/12/2026	£ 600	659	0,23	British Land Co. PLC 2,375 % éch. 14/09/2029	1 400	1 359	0,47			
Arcadis NV 4,875 % éch. 28/02/2028	€ 400	437	0,15	3,750 % éch. 07/09/2029	€ 1 900	2 050	0,71	Burberry Group PLC 1,125 % éch. 21/09/2025	600	677	0,23			
				ROYAUME-UNI OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Cadent Finance PLC 4,250 % éch. 05/07/2029	€ 100	109	0,04			
				ÉMISSIONS SOUVERAINES				(a)						
				ÉMISSIONS SOUVERAINES				Chanel Ceres PLC 1,000 % éch. 31/07/2031	2 200	1 917	0,66			
				ÉMISSIONS SOUVERAINES				Compass Group PLC 4,375 % éch. 08/09/2032	£ 1 900	2 221	0,77			

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 Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	75	\$ 15	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	206	271	0,09
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	22	(46)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	2	(7)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Court	09/2023	16	49	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	741	(1 223)	(0,42)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	186	(351)	(0,12)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra long terme septembre	Long	09/2023	40	(42)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	55	(108)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	68	73	0,02
				\$ (1 369)	(0,47)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (1 369)	(0,47)

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	3,250 %	20/09/2053	£ 700	\$ 61	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	08/07/2023	\$ 100	(1)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	3 200	(165)	(0,05)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,840	08/07/2051	100	31	0,01
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,943	15/06/2051	400	112	0,04
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,000	16/06/2026	CAD 900	(57)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	08/07/2023	\$ 100	1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,943	15/09/2023	400	4	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	€ 1 800	(22)	(0,01)
À payer ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	4 900	(59)	(0,02)
					\$ (95)	(0,03)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (95)	(0,03)

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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	08/2023	€	\$ 459	\$ 499	\$ 0	\$ (3)	0,00
	08/2023	\$	189	AUD 279	0	(3)	0,00
	08/2023		355	€ 331	7	7	0,00
BPS	08/2023		339	¥ 46 900	0	(13)	0,00
	08/2023	€	1 560	\$ 1 695	1	(11)	0,00
	08/2023	\$	4 369	€ 4 051	60	0	0,02
BRC	08/2023	£	917	\$ 1 150	0	(15)	(0,01)
	08/2023	\$	644	£ 521	18	0	0,01
CBK	08/2023	CAD	6 658	\$ 4 993	0	(42)	(0,01)
	08/2023	€	3 753	\$ 4 067	2	(38)	(0,01)
	08/2023	£	1 944	2 424	0	(48)	(0,02)
	08/2023	SEK	987	97	6	0	0,00
JPM	08/2023	\$	1 488	€ 1 379	19	0	0,01
	08/2023	€	488	£ 394	13	0	0,00
	08/2023	€	18 161	\$ 20 004	149	0	0,05
	08/2023	£	9 768	\$ 12 371	0	(50)	(0,02)
MBC	08/2023	\$	394	£ 317	9	0	0,00
	08/2023	€	106 662	\$ 117 699	1 089	0	0,38
MYI	07/2023		5	6	0	0	0,00
	07/2023	£	45	57	0	0	0,00
	07/2023	\$	2 587	£ 2 050	20	0	0,01
	08/2023	¥	5 053	\$ 38	3	0	0,00
RBC	08/2023	£	1 895	2 394	0	(16)	(0,01)
SCX	08/2023	\$	915	¥ 126 800	0	(32)	(0,01)
UAG	08/2023	£	8 556	\$ 10 814	0	(65)	(0,02)
				\$ 1 396	\$ (336)	\$ 1 060	0,37

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
CBK	07/2023	\$ 82	AUD 126	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
GLM	07/2023	82	126	2	0	2	0,00
MBC	07/2023	60	92	1	0	1	0,00
SCX	07/2023	AUD 37	\$ 25	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 21	AUD 32	1	0	1	0,00
	08/2023	25	37	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00

Au 30 juin 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	07/2023	CHF 236	\$ 264	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 356	CHF 322	4	0	4	0,00
	08/2023	264	235	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	CHF 9	\$ 9	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	\$ 254	CHF 228	1	0	1	0,00
UAG	07/2023	CHF 244	\$ 272	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 229	CHF 206	1	0	1	0,00
	08/2023	272	243	1	0	1	0,00
				\$ 7	\$ (1)	\$ 6	0,00

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 107	\$ 116	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$ 60 540	€ 56 331	917	0	917	0,32
BPS	07/2023	€ 54 998	\$ 60 260	257	0	257	0,09
	07/2023	\$ 59 968	€ 55 775	882	0	882	0,30
	08/2023	59 780	54 482	0	(258)	(258)	(0,09)
CBK	07/2023	€ 55 738	\$ 60 581	0	(228)	(228)	(0,08)
	07/2023	\$ 1 325	€ 1 212	1	(4)	(3)	0,00
	08/2023	59 272	54 441	205	0	205	0,07
JPM	07/2023	€ 54 441	\$ 59 444	49	0	49	0,02
	07/2023	\$ 4 803	€ 4 492	98	0	98	0,03
	08/2023	59 527	54 441	0	(51)	(51)	(0,02)
MBC	07/2023	€ 76	\$ 81	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$ 2 989	€ 2 784	49	(1)	48	0,02
MYI	07/2023	€ 9 635	\$ 10 455	0	(57)	(57)	(0,02)
SOG	07/2023	\$ 59 362	€ 55 183	842	0	842	0,29
				\$ 3 300	\$ (602)	\$ 2 698	0,93

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 46	£ 37	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	07/2023	£ 11	\$ 14	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 26 260	£ 21 231	732	0	732	0,25
BRC	07/2023	£ 216	\$ 275	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 60	£ 48	1	0	1	0,00
CBK	07/2023	£ 124	\$ 157	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 510	£ 402	2	0	2	0,00
JPM	07/2023	£ 21 830	\$ 27 602	0	(152)	(152)	(0,05)
	08/2023	\$ 27 607	£ 21 830	152	0	152	0,05
MBC	07/2023	£ 55	\$ 70	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 26 334	£ 21 272	710	0	710	0,25
MYI	07/2023	£ 694	\$ 861	0	(22)	(22)	(0,01)
	07/2023	\$ 26 061	£ 20 968	597	0	597	0,21
RBC	07/2023	3 947	3 102	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07/2023	£ 256	\$ 318	0	(7)	(7)	0,00
				\$ 2 195	\$ (184)	\$ 2 011	0,70

Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)

Au 30 juin 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
AZD	07/2023	SEK 25 919	\$ 2 402	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BOA	07/2023	25 914	2 406	7	0	7	0,00
	07/2023	\$ 1 802	SEK 19 513	5	0	5	0,00
	08/2023	532	5 733	0	0	0	0,00
BRC	07/2023	SEK 25 872	\$ 2 422	27	0	27	0,01
	07/2023	\$ 34	SEK 366	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	SEK 20 143	\$ 1 871	6	0	6	0,00
	07/2023	\$ 5 554	SEK 60 664	62	0	62	0,02
GLM	07/2023	SEK 25 876	\$ 2 422	26	0	26	0,01
MBC	07/2023	25	2	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 4 675	SEK 50 344	0	(14)	(14)	0,00
SCX	07/2023	SEK 20 305	\$ 1 886	6	0	6	0,00
	07/2023	\$ 4 685	SEK 50 679	6	0	6	0,00
UAG	07/2023	SEK 25 919	\$ 2 390	0	(10)	(10)	0,00
				\$ 147	\$ (24)	\$ 123	0,04

Au 30 juin 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
BRC	07/2023	\$ 1 372	SGD 1 857	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	07/2023	SGD 97	\$ 72	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 25	SGD 34	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	1 251	1 690	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	SGD 75	\$ 55	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	1 760	1 302	2	0	2	0,00
	08/2023	\$ 1 302	SGD 1 758	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07/2023	198	268	0	0	0	0,00
UAG	07/2023	SGD 20	\$ 15	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 1 348	SGD 1 824	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 3	\$ (5)	\$ (2)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 5 902 2,04

Total des Investissements

\$ 287 911 99,44

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 1 613 0,56

Actifs nets

\$ 289 524 100,00

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) Titres à coupon zéro.
- (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 : 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	\$ 490	0,17

Un montant en numéraire de 3 962 \$ (31 décembre 2022 : 3 781 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 0 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 249 473	\$ 0	\$ 249 473
Contrats de mise en pension	0	34 000	0	34 000
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	306	4 132	0	4 438
Totaux	\$ 306	\$ 287 605	\$ 0	\$ 287 911

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ S/O	\$ S/O	\$ S/O
BOA	917	(700)	217	(522)	560	38
BPS	1 667	(1 540)	127	(3 021)	2 670	(351)
BRC	31	(20)	11	(6)	40	34
CBK	(42)	0	(42)	1 594	(1 510)	84
DUB	S/O	S/O	S/O	(1 016)	990	(26)
GLM	29	0	29	42	(110)	(68)
JPM	204	(350)	(146)	16	0	16
MBC	1 830	(1 800)	30	1 318	(1 270)	48
MYI	541	(350)	191	43	(20)	23
RBC	(19)	0	(19)	0	0	0
RYL	S/O	S/O	S/O	(113)	0	(113)
SCX	(25)	0	(25)	1 674	(1 560)	114
SOG	842	(630)	212	S/O	S/O	S/O
UAG	(75)	0	(75)	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	76,41	73,76
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	9,75	11,04
Autres valeurs mobilières	S/O	0,04
Contrats de mise en pension	11,74	12,57
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,47)	0,81
Instruments financiers dérivés compensés	(0,03)	0,06
Instruments financiers dérivés hors cote	2,04	0,03

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	0,31	0,31
Autriche	0,44	0,21
Belgique	0,43	0,40
Brésil	S/O	0,07
Canada	1,73	1,62
Chili	0,73	0,70
Chypre	0,30	0,28
République tchèque	0,22	S/O
Danemark	1,12	S/O
Finlande	1,22	0,28
France	6,47	6,29
Allemagne	12,63	11,61
Hong Kong	0,27	S/O
Inde	1,11	1,30
Irlande	2,18	1,49
Italie	1,69	1,97
Japon	3,55	3,29
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,38	0,36
Luxembourg	3,01	2,89
Île Maurice	0,12	0,97
Mexique	0,31	0,29
Multinationales	0,54	0,87
Pays-Bas	8,30	8,65
Norvège	0,63	S/O
Singapour	0,20	0,20

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Corée du Sud	0,56	0,31
Espagne	2,55	2,01
Supranationales	7,13	4,97
Suède	1,24	1,20
Suisse	S/O	0,30
Royaume-Uni	9,29	8,79
États-Unis	17,23	21,97
Îles Vierges britanniques	0,27	0,26
Instruments à court terme	S/O	0,98
Contrats de mise en pension	11,74	12,57
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,47)	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	1,67	1,56
Autres actifs et passifs à court terme	0,56	1,69
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				DANEMARK				DESCRIPTION			
AUSTRALIE				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				INVESCO EURO CLO DAC			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Jyske Realkredit A/S				4,097 % éch. 15/07/2032			
Obligation internationale du gouvernement australien				1,000 % éch. 01/10/2050				€ 2 600 \$ 2 768 0,28			
0,250 % éch. 21/11/2032	AUD	5 495	\$ 3 207 0,33	1,000 % éch. 01/10/2053	6 301	612	0,06	Jubilée CLO DAC			
0,750 % éch. 21/11/2027		4 186	2 706 0,28	1,500 % éch. 01/10/2053	6 938	753	0,08	4,326 % éch. 15/12/2029			
3,000 % éch. 20/09/2025		1 726	1 185 0,12	2,000 % éch. 01/10/2053	2 778	317	0,03	Laurelin DAC			
Total Australie		7 098	0,73	2,500 % éch. 01/10/2047	1	0	0,00	3,920 % éch. 20/10/2031			
CANADA				NORDEA KREDIT REALKREDITAKTIESELSKAB				Madison Park Euro Funding DAC			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				0,500 % éch. 01/10/2043				3,977 % éch. 15/07/2032			
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien				1,000 % éch. 01/10/2050				700			
0,500 % éch. 01/12/2050 (a)	CAD	241	145 0,01	1,000 % éch. 01/10/2050	0	0	0,00	Man GLG Euro CLO DAC			
4,250 % éch. 01/12/2026 (a)		2 849	2 320 0,24	1,500 % éch. 01/10/2053	3 900	397	0,04	4,047 % éch. 15/01/2030			
Total Canada		2 465	0,25	2,000 % éch. 01/10/2053	999	114	0,01	Oak Hill European Credit Partners DAC			
ÎLES CAIMANS				NYKREDIT REALKREDIT A/S				3,940 % éch. 20/10/2031			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				1,000 % éch. 01/10/2050				1 100			
Allegro CLO Ltd.				1,000 % éch. 01/10/2053				2 600			
6,425 % éch. 16/10/2031	\$	500	495 0,05	1,500 % éch. 01/10/2053	85 897	8 950	0,92	OCF Euro CLO DAC			
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				2,000 % éch. 01/10/2053				4,091 % éch. 22/09/2034			
6,350 % éch. 15/01/2031		6 063	5 985 0,62	2,500 % éch. 01/10/2047	13	2	0,00	2 600			
6,410 % éch. 16/01/2030		938	933 0,10	3,500 % éch. 01/10/2053	14 485	1 939	0,20	Palmer Square European Loan Funding DAC			
BlueMountain CLO Ltd.				REALKREDIT DANMARK A/S				3,897 % éch. 15/10/2031			
6,453 % éch. 22/10/2030		1 705	1 697 0,17	1,000 % éch. 01/10/2050	13 858	1 460	0,15	844			
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				1,000 % éch. 01/10/2053				2 600			
6,260 % éch. 15/01/2031		584	579 0,06	1,500 % éch. 01/10/2053	17 747	1 913	0,20	Rockford Tower Europe CLO DAC			
Catamaran CLO Ltd.				2,000 % éch. 01/10/2053				4,577 % éch. 20/12/2031			
6,373 % éch. 22/04/2030		2 470	2 455 0,25	2,500 % éch. 01/04/2047	12	2	0,00	2 518			
Cedar Funding CLO Ltd.				ÉMISSIONS SOUVERAINES				TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
6,360 % éch. 17/07/2031		700	694 0,07	Obligation internationale du gouvernement danois				European Loan Conduit DAC			
CFC Funding Ltd.				0,100 % éch. 15/11/2023 (a)				13 470			
6,352 % éch. 27/04/2031		1 200	1 190 0,12	1 976				573			
Dryden CLO Ltd.				FRANCE				613			
6,331 % éch. 15/05/2031		700	694 0,07	ÉMISSIONS SOUVERAINES				53 371			
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				Obligation internationale du gouvernement français				2,48			
6,373 % éch. 15/09/2037		1 623	1 601 0,16	0,100 % éch. 01/03/2025 (a)				19 962			
ICG U.S. CLO Ltd.				0,100 % éch. 25/07/2031 (a)				9 707			
6,353 % éch. 22/07/2031		2 500	2 472 0,25	0,100 % éch. 25/07/2038 (a)				7 005			
LCM LP				2,100 % éch. 25/07/2023 (a)				34 194			
6,290 % éch. 20/07/2031		3 300	3 268 0,34	Total France				76 067			
6,390 % éch. 15/10/2030		1 200	1 185 0,12	7,82				2,27			
Madison Park Funding Ltd.				IRLANDE				ITALIE			
0,000 % éch. 29/07/2030		395	394 0,04	TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
6,103 % éch. 22/04/2027		273	271 0,03	Ares European CLO				Obligation internationale du gouvernement japonais			
Magnetite Ltd.				3,837 % éch. 15/10/2030				1 391			
6,240 % éch. 15/04/2031		295	293 0,03	Ares European CLO DAC				0,005 % éch. 10/03/2031 (a)			
Octagon Investment Partners Ltd.				3,787 % éch. 15/04/2030				1 489			
6,220 % éch. 16/04/2031		3 500	3 466 0,36	4,050 % éch. 20/04/2032				0,100 % éch. 10/09/2024 (a)			
Octagon Loan Funding Ltd.				Armada Euro CLO DAC				938 960			
6,525 % éch. 18/11/2031		2 500	2 477 0,26	3,897 % éch. 15/07/2031				1 020 895			
OZLM Ltd.				Bain Capital Euro CLO DAC				773 102			
6,340 % éch. 17/04/2031		2 759	2 721 0,28	4,311 % éch. 24/01/2033				0,100 % éch. 10/03/2028 (a)			
6,400 % éch. 20/01/2031		3 243	3 212 0,33	Black Diamond CLO DAC				1 337 314			
Regatta Funding Ltd.				4,060 % éch. 20/01/2032				4 239 309			
6,510 % éch. 17/10/2030		3 879	3 862 0,40	4,303 % éch. 15/05/2032				31 047			
Sound Point CLO Ltd.				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				6,47			
6,368 % éch. 26/07/2031		1 500	1 474 0,15	1,050 % éch. 15/01/2031				0,005 % éch. 10/03/2019 (a)			
6,370 % éch. 21/01/2031		1 373	1 351 0,14	3,897 % éch. 15/01/2031				0,100 % éch. 10/09/2024 (a)			
6,412 % éch. 18/04/2031		2 200	2 162 0,22	BNPP AM Euro CLO DAC				938 960			
TIAA CLO Ltd.				3,777 % éch. 15/04/2031				1 020 895			
6,450 % éch. 20/07/2031		500	494 0,05	Cairn CLO DAC				773 102			
Voya CLO Ltd.				3,957 % éch. 15/10/2031				1 337 314			
6,351 % éch. 14/07/2031		495	490 0,05	4,212 % éch. 20/10/2028				1 337 314			
6,458 % éch. 15/10/2030		1 829	1 823 0,19	Carlyle Euro CLO DAC				4 239 309			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,213 % éch. 15/08/2032				31 047			
Avolon Holdings Funding Ltd.				CVC Cordatus Loan Fund DAC				62 962			
2,528 % éch. 18/11/2027		258	218 0,02	4,305 % éch. 26/08/2032				6,47			
Total Îles Caïmans		47 956	4,93	Dryden Euro CLO DAC				6,47			
				4,073 % éch. 15/05/2032				6,47			
				4,183 % éch. 15/05/2034				6,47			
				Harvest CLO DAC				6,47			
				1,040 % éch. 15/07/2031				6,47			
				3,937 % éch. 15/07/2031				6,47			
				4,250 % éch. 26/06/2030				6,47			
				1,418				6,47			
				1,516				6,47			
				0,16				6,47			

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
0,650 % éch. 30/11/2027 (a)	€ 26 866	\$ 28 789	2,96
0,700 % éch. 30/11/2033 (a)	1 324	1 382	0,14
		50 578	5,20
Total Espagne		51 011	5,24

SUÈDE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement suédois			
0,125 % éch. 01/06/2026	SEK 3 059	275	0,03
0,125 % éch. 01/12/2027	15 965	1 428	0,15
1,000 % éch. 01/06/2025	124 211	11 427	1,17
Total Suède		13 130	1,35

SUISSE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
UBS Group AG			
2,593 % éch. 11/09/2025	\$ 600	572	0,06
4,177 % éch. 16/01/2026	€ 400	430	0,04
Total Suisse		1 002	0,10

ROYAUME-UNI			
TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Great Hall Mortgages PLC			
5,152 % éch. 18/03/2029	£ 6	8	0,00
5,172 % éch. 18/06/2038	6	7	0,00
Polaris PLC			
5,640 % éch. 23/10/2059	3 456	4 363	0,45
Towd Point Mortgage Funding PLC			
5,635 % éch. 20/10/2051	835	1 063	0,11
		5 441	0,56

ACTIONS			
TITRES PRIVILÉGIÉS			
Nationwide Building Society			
10,250 %	1 606	235	0,02

VALEUR NOMINALE (en milliers)			

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Bon du Trésor britannique			
0,125 % éch. 22/03/2024 (a)	£ 17 538	21 868	2,25
0,125 % éch. 22/03/2026 (a)	175	214	0,02
0,125 % éch. 10/08/2026 (a)	4 470	5 467	0,56
0,125 % éch. 10/08/2041 (a)	4 524	5 028	0,52
1,250 % éch. 22/11/2027 (a)	40 705	52 277	5,37
2,500 % éch. 17/07/2024	23 479	30 455	3,13
		115 309	11,85
Total Royaume-Uni		120 985	12,43

ÉTATS-UNIS			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS			

ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
6,200 % éch. 25/12/2033	\$ 786	766	0,08
Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,110 % éch. 25/10/2035	1 300	1 164	0,12
Asset-Backed Funding Certificates Trust			
5,290 % éch. 25/10/2036	2 300	2 100	0,22
5,750 % éch. 25/10/2034	103	103	0,01
CIT Mortgage Loan Trust			
6,500 % éch. 25/10/2037	54	54	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust			
5,440 % éch. 25/09/2036	458	433	0,05
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,095 % éch. 25/10/2034	291	275	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
5,840 % éch. 25/10/2035 ^	800	716	0,07
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
6,110 % éch. 25/02/2036	1 906	1 858	0,19
Ellington Loan Acquisition Trust			
6,250 % éch. 25/05/2037	599	574	0,06
First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,460 % éch. 25/07/2036	150	141	0,01

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Home Equity Asset Trust			
6,005 % éch. 25/08/2034	\$ 98	\$ 96	0,01
6,170 % éch. 25/03/2035	1 465	1 383	0,14
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
5,290 % éch. 25/11/2036	661	594	0,06
Lehman XS Trust			
7,450 % éch. 25/12/2037	826	837	0,09
Mid-State Capital Corp. Trust			
5,787 % éch. 15/10/2040	79	77	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
5,810 % éch. 25/01/2035	331	320	0,03
6,125 % éch. 25/07/2034	139	134	0,01
New Century Home Equity Loan Trust			
5,915 % éch. 25/02/2035	472	431	0,04
Option One Mortgage Loan Trust			
5,690 % éch. 25/01/2036	1 700	1 517	0,16
Renaissance Home Equity Loan Trust			
6,350 % éch. 25/11/2034	184	152	0,02
Saxon Asset Securities Trust			
5,460 % éch. 25/09/2037	239	226	0,02
5,585 % éch. 25/09/2036	3 000	2 750	0,28
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5,870 % éch. 25/10/2035	1 495	1 198	0,12
		17 899	1,84

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Broadcom, Inc.			
3,137 % éch. 15/11/2035	1 459	1 119	0,12
Lehman Brothers Holdings, Inc.			
7,875 % éch. 08/05/2018 ^	£ 100	1	0,00
		1 120	0,12

OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX			
Obligations American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010			
7,734 % éch. 15/02/2033	\$ 200	237	0,03
Obligations Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
6,918 % éch. 01/04/2040	600	708	0,07
Obligations California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009			
7,300 % éch. 01/10/2039	500	605	0,06
7,500 % éch. 01/04/2034	100	122	0,01
7,550 % éch. 01/04/2039	200	252	0,03
Obligations Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010			
5,516 % éch. 01/07/2027	500	511	0,05
Obligations New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
5,508 % éch. 01/08/2037	200	208	0,02
Obligations New York State Urban Development Corp. Revenue Bonds, (BABs), Series 2009			
5,770 % éch. 15/03/2039	100	105	0,01
		2 748	0,28

TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Banc of America Funding Trust			
4,496 % éch. 20/09/2034	7	6	0,00
BCAP LLC Trust			
5,250 % éch. 26/04/2037	190	111	0,01
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
3,553 % éch. 25/09/2034	52	48	0,01
3,887 % éch. 25/05/2047 ^	6	5	0,00
4,033 % éch. 25/11/2034	4	4	0,00
4,033 % éch. 25/01/2035	21	19	0,00
4,439 % éch. 25/02/2034	7	6	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust			
4,116 % éch. 25/08/2036 ^	12	6	0,00
5,044 % éch. 25/10/2033	7	7	0,00
Chase Mortgage Finance Trust			
4,086 % éch. 25/03/2037 ^	4	4	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
5,500 % éch. 25/08/2034	0	0	0,00
6,430 % éch. 25/09/2035	1	1	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust			
3,940 % éch. 25/02/2037 ^	6	5	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
5,367 % éch. 20/07/2046 ^	\$ 8	\$ 7	0,00
5,530 % éch. 25/09/2046 ^	8	7	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
3,611 % éch. 25/09/2047 ^	5	5	0,00
5,790 % éch. 25/03/2035	63	59	0,01
5,910 % éch. 25/09/2034	1	1	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust			
5,590 % éch. 25/06/2045	69	65	0,01
GSR Mortgage Loan Trust			
4,070 % éch. 25/09/2035	2	2	0,00
4,485 % éch. 25/06/2034	4	3	0,00
4,660 % éch. 25/07/2035	38	36	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust			
6,057 % éch. 20/06/2035	185	167	0,02
Impac CMB Trust			
6,050 % éch. 25/10/2033	1	1	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust			
5,630 % éch. 25/07/2035	1 280	1 201	0,12
5,790 % éch. 25/07/2045	3	2	0,00
JPMorgan Mortgage Trust			
4,111 % éch. 25/04/2035	19	18	0,00
4,356 % éch. 25/08/2035	6	6	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust			
5,633 % éch. 15/12/2030	1	1	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5,840 % éch. 25/08/2036	3 500	3 292	0,34
New Residential Mortgage Loan Trust			
4,500 % éch. 25/05/2058	428	409	0,04
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,950 % éch. 25/04/2035	500	480	0,05
Regal Trust			
3,910 % éch. 29/09/2031	6	5	0,00
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
6,500 % éch. 25/03/2032	6	6	0,00
Sequoia Mortgage Trust			
4,601 % éch. 20/04/2035	17	16	0,00
5,557 % éch. 20/07/2036	505	433	0,04
5,846 % éch. 19/10/2026	3	2	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
5,726 % éch. 19/07/2034	2	1	0,00
5,806 % éch. 19/10/2034	8	7	0,00
5,846 % éch. 19/03/2034	6	6	0,00
Towd Point Mortgage Trust			
2,750 % éch. 25/10/2056	264	261	0,03
3,250 % éch. 25/03/2058	524	500	0,05
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
5,376 % éch. 25/06/2042	1	1	0,00
5,770 % éch. 25/01/2045	10	10	0,00
5,890 % éch. 25/01/2045	52	51	0,01
5,930 % éch. 25/10/2044	154	142	0,02
		7 425	0,76

AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Fannie Mae			
5,188 % éch. 01/11/2034	157	156	0,02
5,720 % éch. 25/09/2036	1	1	0,00
6,000 % éch. 25/02/2044	4	4	0,00
6,500 % éch. 25/06/2028	4	4	0,00
Freddie Mac			
4,350 % éch. 01/01/2034	1	1	0,00
5,000 % éch. 15/01/2035	157	155	0,02
5,290 % éch. 25/09/2031	8	8	0,00
5,643 % éch. 15/12/2031	1	1	0,00
5,693 % éch. 15/04/2028	3	3	0,00
5,793 % éch. 15/03/2024	0	0	0,00
5,843 % éch. 15/03/2032	45	45	0,01
6,000 % éch. 15/04/2036	3	3	0,00
Ginnie Mae			
2,887 % éch. 20/10/2043	405	389	0,04
3,858 % éch. 20/08/2068	519	505	0,05
5,284 % éch. 20/07/2062	423	422	0,04
5,407 % éch. 20/02/2035	24	24	0,00
5,617 % éch. 20/08/2062	691	685	0,07
5,636 % éch. 20/02/2038	13	13	0,00
5,710 % éch. 20/03/2060	16	16	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
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				0,375 % éch. 15/01/2027	\$ 27 323	\$ 25 643	2,63	INSTRUMENTS À COURT TERME			
4,000 % éch. 01/08/2053	\$ 62 714	\$ 58 910	6,05	0,375 % éch. 15/07/2027				BILLETTS DE TRÉSORERIE			
4,500 % éch. 01/08/2053	31 500	30 302	3,12	(e)(f)	39 777	37 299	3,83	Ameren Corp.			
		91 647	9,42	0,500 % éch. 15/04/2024 (e)	30 462	29 728	3,05	5,400 % éch. 21/07/2023	\$ 1 000	\$ 997	0,10
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				0,500 % éch. 15/01/2028	34 061	31 870	3,27	5,400 % éch. 24/07/2023	3 200	3 189	0,33
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (a)				0,625 % éch. 15/01/2026	20 833	19 868	2,04	Virginia Electric & Power Co.			
0,125 % éch. 15/07/2024 (e)	38 066	36 929	3,79	0,750 % éch. 15/02/2028	24 203	22 943	2,36	5,330 % éch. 13/07/2023	400	399	0,04
0,125 % éch. 15/10/2024 (e)	75 543	72 873	7,49	0,750 % éch. 15/02/2045	773	639	0,07	Total des Instruments à court terme		4 585	0,47
0,125 % éch. 15/04/2025				0,875 % éch. 15/02/2047	880	739	0,08				
0,125 % éch. 15/10/2025	36 167	34 411	3,54	1,375 % éch. 15/02/2044	2 993	2 822	0,29	Total des valeurs mobilières	\$ 1 389 961	142,83	
0,125 % éch. 15/10/2026	28 523	27 046	2,78	1,500 % éch. 15/02/2053	2 143	2 082	0,21				
0,125 % éch. 15/04/2026 (e)	51 733	48 520	4,99	1,625 % éch. 15/10/2027				ACTIONS			
0,125 % éch. 15/07/2026	6 972	6 551	0,67	(e)(f)	95 275	93 904	9,65	FONDS D'INVESTISSEMENT			
0,125 % éch. 15/10/2026 (e)	128 648	120 297	12,36	1,750 % éch. 15/01/2028	5 137	5 079	0,52	ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
0,125 % éch. 15/07/2031	1 154	1 024	0,11	2,375 % éch. 15/01/2025	17 217	17 040	1,75	PIMCO Select Funds plc -			
0,250 % éch. 15/01/2025 (e)	44 436	42 603	4,38	2,500 % éch. 15/01/2029	1 708	1 760	0,18	Fonds PIMCO US Dollar			
0,250 % éch. 15/07/2029	1 909	1 744	0,18	3,875 % éch. 15/04/2029	1 201	1 327	0,14	Short-Term Floating			
0,375 % éch. 15/07/2025	19 932	19 077	1,96					NAV Fund (c)	12 345	123	0,01
				Total États-Unis		703 818	72,32	Total des Fonds d'investissement	\$ 123	0,01	
						824 657	84,74				

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 2 394	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	\$ (2 442)	\$ 2 394	\$ 2 394	0,25	
Total des contrats de mise en pension							\$ (2 442)	\$ 2 394	\$ 2 394	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 billet du gouvernement australien à 3 ans septembre	Court	09/2023	69	\$ 27	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Court	09/2023	63	26	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Long	09/2023	326	(486)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Long	09/2023	16	(17)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	339	376	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	731	514	0,05
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	114	(215)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Court	09/2023	15	12	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	1 208	1 119	0,12
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	48	(177)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Court	09/2023	339	229	0,03
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	1 107	2 341	0,24
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	1 032	(2 044)	(0,21)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	520	174	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Court	09/2023	548	(62)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	111	200	0,02
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	4	4	0,00
				\$ 2 021	0,21

OPTIONS VENDUES

OPTIONS 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 113,000	21/07/2023	153	\$ (108)	\$ (170)	(0,02)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					\$ 1 851	0,19

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return 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
General Electric Co.	1,000 %	20/12/2023	\$ 200	\$ 13	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 recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,500 %	16/03/2042	£ 7 200	\$ 587	0,06
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,300	20/09/2027	¥ 74 880	0	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/12/2031	2 466 000	(104)	(0,01)
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,000	15/12/2047	\$ 1 750	391	0,04
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,428	20/12/2047	400	60	0,01
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,478	20/12/2047	1 115	155	0,02
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,499	20/12/2047	570	79	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,840	21/11/2028	13 800	1 318	0,14
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,880	25/01/2052	5 000	(1 403)	(0,14)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,888	21/11/2053	2 800	(792)	(0,08)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,865	13/02/2054	18 600	406	0,04
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,085	13/02/2034	41 800	(751)	(0,08)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,250	20/12/2025	4 400	26	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 3 mois	0,526	21/11/2023	€ 9 900	(252)	(0,03)
À recevoir	BBR NZD à 3 mois	3,250	21/03/2028	NZD 900	27	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/07/2023	\$ 5 000	(20)	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	17/03/2053	€ 1 200	565	0,06
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,190	04/11/2052	900	413	0,04
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,195	04/11/2052	950	493	0,05
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,197	08/11/2052	1 600	731	0,08
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	200	(9)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	4 900	(520)	(0,05)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	2 400	(250)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	2 100	(220)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	4 700	(441)	(0,05)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	2 100	(197)	(0,02)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	5 800	(74)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,879	15/08/2032	13 400	(165)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	91 100	662	0,07
À payer	CPTFEMU	1,066	15/02/2024	3 800	(565)	(0,06)
À payer	CPTFEMU	1,168	15/03/2024	3 300	(496)	(0,05)
À payer	CPTFEMU	1,380	15/03/2031	4 000	(891)	(0,09)
À payer	CPTFEMU	1,946	15/03/2048	60	(18)	0,00
À payer	CPTFEMU	2,421	15/05/2052	700	(115)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	2,470	15/07/2032	11 900	381	0,04
À payer	CPTFEMU	2,488	15/05/2037	4 790	(365)	(0,04)
À recevoir	CPTFEMU	2,570	15/06/2032	8 800	340	0,03
À payer	CPTFEMU	2,580	15/03/2052	500	(66)	(0,01)
À payer	CPTFEMU	2,590	15/03/2052	4 940	(601)	(0,06)
À recevoir	CPTFEMU	2,600	15/05/2032	10 600	496	0,05
À payer	CPTFEMU	2,680	15/04/2053	2 100	(31)	0,00
À payer	CPTFEMU	2,700	15/04/2053	1 100	(15)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,520	15/09/2024	13 600	(174)	(0,02)
À payer	CPTFEMU	3,720	15/09/2024	5 000	(34)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,850	15/09/2024	19 500	(121)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	4,375	15/06/2024	100 000	939	0,10
À recevoir	CPURNSA	1,798	25/08/2027	\$ 1 000	144	0,01
À recevoir	CPURNSA	1,890	27/08/2027	3 000	414	0,04
À payer	CPURNSA	1,954	03/06/2029	700	(93)	(0,01)
À payer	CPURNSA	1,998	25/07/2029	3 600	(459)	(0,05)
À payer	CPURNSA	2,155	17/10/2027	1 900	(216)	(0,02)
À recevoir	CPURNSA	2,311	24/02/2031	5 100	548	0,06
À payer	CPURNSA	2,335	05/02/2028	2 680	(247)	(0,03)
À payer	CPURNSA	2,353	09/05/2028	1 790	(156)	(0,02)
À payer	CPURNSA	2,360	09/05/2028	2 690	(232)	(0,02)
À payer	CPURNSA	2,364	10/05/2028	2 750	(236)	(0,02)
À recevoir	CPURNSA	2,419	05/03/2026	2 300	215	0,02
À recevoir	CPURNSA	2,573	26/08/2028	1 100	68	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,645	10/09/2028	1 500	81	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,690	01/06/2026	2 100	157	0,02
À recevoir	CPURNSA	2,703	25/05/2026	1 270	95	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,768	13/05/2026	3 100	226	0,02
À recevoir	CPURNSA	2,813	14/05/2026	1 400	99	0,01
À recevoir	FRCPXTOB	1,030	15/03/2024	€ 3 300	316	0,03
À payer	FRCPXTOB	1,910	15/01/2038	390	(75)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,100	15/06/2031	£ 2 300	(523)	(0,05)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,400	15/06/2030	1 610	(437)	(0,04)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,515	15/02/2041	2 700	(445)	(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 payer	IPC Royaume-Uni	3,530 %	15/10/2031	£ 540	\$ (150)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,566	15/03/2036	2 700	(552)	(0,06)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,580	15/03/2036	2 000	(485)	(0,05)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,066	15/09/2031	300	(54)	(0,01)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,125	15/09/2032	590	30	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,130	15/09/2032	2 610	131	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,143	15/10/2032	2 300	112	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,480	15/09/2023	1 500	252	0,03
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,200	15/06/2024	1 200	78	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,600	15/05/2024	4 200	255	0,03
					\$ (1 760)	(0,18)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (1 747)	(0,18)

(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.

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
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,237 %	17/11/2023	10 300	\$ 639	\$ 2 260	0,23

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	\$ (55)	\$ (68)	(0,01)

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	3,750 %	12/09/2023	24 700	\$ (70)	\$ (28)	0,00
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,340	17/11/2023	50 700	(639)	(3 740)	(0,39)
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,420	21/09/2023	115 100	(655)	(492)	(0,05)
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	12/09/2023	34 500	(96)	(40)	0,00
						\$ (1 460)	\$ (4 300)	(0,44)	

(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	\$ 1 500	\$ (104)	\$ 104	\$ 0	0,00
GST	Indice CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17/10/2057	1 800	(94)	93	(1)	0,00
					\$ (198)	\$ 197	\$ (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.

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return 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 payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998 %	20/06/2028	ILS 890	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	0,00
BRC	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,950	20/06/2028	810	0	(17)	(17)	0,00
CKL	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	2,100	20/06/2028	750	(2)	(13)	(15)	0,00
GLM	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,971	16/02/2028	1 430	0	(27)	(27)	(0,01)
HUS	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998	20/06/2028	610	0	(13)	(13)	0,00
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998	20/06/2028	480	0	(10)	(10)	0,00
						\$ (2)	\$ (98)	\$ (100)	(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 Index	151 171	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	\$ 34 887	15/02/2024	\$ 148	\$ (839)	\$ (691)	(0,07)
	À recevoir	Indice BCOMTR1 Index	1 368 505	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	120 736	15/02/2024	0	(2 378)	(2 378)	(0,24)
CBK	À recevoir	Indice BCOMF1TC Index	348 889	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	40 165	15/02/2024	0	(830)	(830)	(0,09)
	À recevoir	Indice BCOMTR Index	55 650	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	12 843	15/02/2024	0	(249)	(249)	(0,03)
	À recevoir	Indice CIXBSTR3 Index	693 551	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	176 505	15/02/2024	0	(3 573)	(3 573)	(0,37)
CIB	À recevoir	Indice BCOMTR Index	179 997	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	41 539	15/02/2024	0	(818)	(818)	(0,08)
FBF	À recevoir	Indice BCOMTR Index	83 595	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	19 292	15/02/2024	0	(380)	(380)	(0,04)
GST	À recevoir	Indice BCOMF1TC Index	235 692	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	87 988	15/02/2024	0	(1 818)	(1 818)	(0,19)
	À recevoir	Indice BCOMTR Index	1 017 108	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	234 725	15/02/2024	0	(4 622)	(4 622)	(0,47)
JPM	À recevoir	Indice BCOMF1TC Index	315 223	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	61 548	15/02/2024	0	(1 272)	(1 272)	(0,13)
	À recevoir	Indice BCOMTR Index	90 706	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	20 933	15/02/2024	0	(412)	(412)	(0,04)
	À recevoir	Indice JMABDEWU Index	494 170	0,053 %	79 161	15/02/2024	0	541	541	0,06
	À recevoir	Indice JMABNIU5 Index	164 986	0,000	29 494	15/02/2024	0	(167)	(167)	(0,02)
MAC	À recevoir	Indice PIMCODBU Index	539 651	0,160	84 217	15/09/2023	0	(856)	(856)	(0,09)
MEI	À recevoir	Indice BCOMTR Index	116 009	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	26 772	15/02/2024	0	(527)	(527)	(0,05)
SOG	À recevoir	Indice BCOMTR Index	9 776	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	2 256	15/02/2024	0	(44)	(44)	0,00
							\$ 148	\$ (18 244)	\$ (18 096)	(1,85)

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	07/2023	AUD	326	\$ 213	\$ 0	\$ (4)	0,00
	07/2023	\$	907	AUD 1 367	3	3	0,00
	08/2023	AUD	1 367	\$ 908	0	(3)	0,00
BOA	07/2023		2 074	1 354	0	(26)	0,00
	07/2023	DKK	194 210	28 045	0	(412)	(0,04)
	07/2023	NZD	823	500	0	(5)	0,00
	07/2023	\$	11 728	DKK 79 740	0	(44)	0,00
	07/2023		552	€ 510	5	5	0,00
	08/2023	DKK	79 606	\$ 11 728	44	44	0,00
BPS	07/2023	€	2 909	3 171	0	(3)	0,00
	07/2023	¥	8 376 035	60 288	2 335	2 335	0,24
	07/2023	NZD	74	45	0	(1)	0,00
	07/2023	\$	647	AUD 977	3	3	0,00
	07/2023		288 740	€ 263 534	6	(1 231)	(0,13)
	08/2023	AUD	977	\$ 648	0	(3)	0,00
	08/2023	€	261 997	287 474	1 243	1 243	0,13
BRC	09/2023	ILS	87	24	1	1	0,00
CBK	07/2023	CAD	3 615	2 653	0	(79)	(0,01)
	07/2023	€	1 446	1 560	0	(17)	0,00
	07/2023	¥	88 700	628	14	14	0,00
	07/2023	\$	922	€ 843	0	(2)	0,00
GLM	07/2023		2 347	DKK 16 270	37	37	0,00
JPM	07/2023	AUD	1 993	\$ 1 303	0	(24)	0,00
	07/2023	\$	1 662	DKK 11 360	6	2	0,00
	07/2023		20 157	¥ 2 882 631	0	(213)	(0,02)
	08/2023	¥	2 870 382	\$ 20 157	213	213	0,02
	09/2023	ILS	83	23	1	1	0,00
	09/2023	PEN	3 744	1 017	0	(10)	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		
MBC	07/2023	£	96 657	\$	119 648	\$ 0	\$ (3 237)	\$ (3 237)	(0,33)
	07/2023	SEK	1 796		167	1	0	1	0,00
	07/2023	\$	1 083	€	1 011	21	0	21	0,00
MYI	07/2023	£	5	\$	7	0	0	0	0,00
	07/2023	SEK	138 692		12 920	80	0	80	0,01
	07/2023	\$	9 688	DKK	66 084	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023		821	€	754	1	0	1	0,00
	07/2023		38	£	30	0	0	0	0,00
	07/2023		13 033	SEK	140 706	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	DKK	65 973	\$	9 688	5	0	5	0,00
	08/2023	SEK	140 532		13 033	6	0	6	0,00
SCX	07/2023	AUD	2 813		1 838	0	(34)	(34)	0,00
	07/2023	NZD	2 144		1 302	0	(12)	(12)	0,00
	07/2023	\$	1 332	AUD	2 007	4	0	4	0,00
	07/2023		40	€	37	0	0	0	0,00
	07/2023		287	£	228	2	0	2	0,00
	08/2023	AUD	2 007	\$	1 333	0	(4)	(4)	0,00
SOG	07/2023		2 152		1 408	0	(24)	(24)	0,00
	07/2023	€	260 006		279 699	0	(3 967)	(3 967)	(0,41)
TOR	07/2023	AUD	1 139		745	0	(13)	(13)	0,00
	07/2023	\$	1 631	AUD	2 470	13	0	13	0,00
	07/2023		2 733	CAD	3 616	2	(2)	0	0,00
	07/2023		122 822	£	96 657	63	0	63	0,01
	07/2023		38 762	¥	5 581 716	0	(143)	(143)	(0,02)
	07/2023		1 852	NZD	3 042	11	0	11	0,00
	08/2023	AUD	2 470	\$	1 633	0	(13)	(13)	0,00
	08/2023	CAD	3 614		2 733	2	(2)	0	0,00
	08/2023	£	96 657		122 849	0	(61)	(61)	(0,01)
	08/2023	¥	5 558 044		38 762	145	0	145	0,01
	08/2023	NZD	3 042		1 852	0	(11)	(11)	0,00
UAG	07/2023	AUD	261		171	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$	2 629	AUD	3 937	6	(14)	(8)	0,00
	08/2023	AUD	3 937	\$	2 631	13	(5)	8	0,00
	09/2023	ILS	72		20	1	0	1	0,00
						\$ 4 287	\$ (9 637)	\$ (5 350)	(0,55)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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		
BOA	07/2023	€	1 350	\$	1 460	\$ 0	\$ (13)	\$ (13)	0,00
	07/2023	\$	112 515	€	104 694	1 707	0	1 707	0,17
BPS	07/2023	€	100 729	\$	110 360	469	(4)	465	0,05
	07/2023	\$	111 227	€	103 466	1 656	0	1 656	0,17
	08/2023		98 812		90 055	0	(428)	(428)	(0,04)
CBK	07/2023	€	92 343	\$	100 383	7	(371)	(364)	(0,04)
	07/2023	\$	4 918	€	4 496	0	(13)	(13)	0,00
	08/2023		91 575		84 111	316	0	316	0,03
JPM	07/2023	€	88 670	\$	96 818	80	0	80	0,01
	07/2023	\$	13 010	€	12 168	266	0	266	0,03
	08/2023		96 954		88 670	0	(83)	(83)	(0,01)
MBC	07/2023	€	6 466	\$	6 934	0	(120)	(120)	(0,01)
	07/2023	\$	2 526	€	2 316	5	(4)	1	0,00
MYI	07/2023	€	25 263	\$	27 608	46	0	46	0,00
SOG	07/2023	\$	111 303	€	103 466	1 580	0	1 580	0,16
UAG	07/2023	€	16 025	\$	17 197	0	(287)	(287)	(0,03)
						\$ 6 132	\$ (1 323)	\$ 4 809	0,49

Au 30 juin 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	07/2023	£	2 883	\$	3 664	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$	14 295	£	11 546	387	(3)	384	0,04
BRC	07/2023	£	10 134	\$	12 906	57	(34)	23	0,00
	07/2023	\$	416	£	327	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2023	£	530	\$	671	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$	713	£	558	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07/2023	£	7 179	\$	9 077	0	(50)	(50)	(0,01)
	08/2023	\$	9 079	£	7 179	50	0	50	0,01
MBC	07/2023	£	287	\$	357	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	\$	14 062	£	11 359	380	0	380	0,04
MYI	07/2023		14 110		11 353	323	0	323	0,03
						\$ 1 197	\$ (102)	\$ 1 095	0,11

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

Au 30 juin 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
GLM	07/2023	SGD	86	\$ 64	\$ 1	\$ 0	0,00
	07/2023	\$	88	SGD 119	0	0	0,00
JPM	07/2023	SGD	402	\$ 297	0	0	0,00
	07/2023	\$	303	SGD 410	0	0	0,00
	08/2023		297	402	0	0	0,00
MBC	07/2023		280	379	(1)	(1)	0,00
	08/2023	SGD	5	\$ 3	0	0	0,00
MYI	07/2023		399	295	0	0	0,00
	08/2023	\$	295	SGD 399	0	0	0,00
UAG	07/2023	SGD	19	\$ 14	0	0	0,00
	07/2023	\$	306	SGD 414	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ (19 751)	(2,03)
Total des Investissements						\$ 1 372 831	141,07
Autres actifs et passifs à court terme						\$ (399 665)	(41,07)
Actifs nets						\$ 973 166	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 montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

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

(c) Affilié au Fonds.

(d) Titre convertible conditionnel.

(e) Des titres d'une juste valeur globale de 339 204 \$ (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 30 juin 2023.

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 22 916 \$ (31 décembre 2022 : 17 272 \$) 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 30 juin 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 157 \$) 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 18 308 \$ (31 décembre 2022 : 19 275 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 31 670 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 1 389 738	\$ 223	\$ 1 389 961
Fonds d'investissement	123	0	0	123
Contrats de mise en pension	0	2 394	0	2 394
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	1 183	(20 830)	0	(19 647)
Totaux	\$ 1 306	\$ 1 371 302	\$ 223	\$ 1 372 831

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	\$ 1 750 918	\$ 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 30 juin 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	5,160 %	27/06/2023	18/07/2023	\$ (12 093)	\$ (12 100)	(1,24)	
	5,180	15/06/2023	13/07/2023	(5 010)	(5 021)	(0,52)	
	5,180	20/06/2023	13/07/2023	(193 962)	(194 269)	(19,96)	
	5,180	26/06/2023	17/07/2023	(9 043)	(9 049)	(0,93)	
GRE	5,180	17/05/2023	17/07/2023	(107 165)	(107 859)	(11,08)	
IND	5,210	28/06/2023	05/07/2023	(10 952)	(10 956)	(1,13)	
Total des contrats de prise en pension					\$ (339 254)	(34,86)	

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 30 juin 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	5,190 %	21/06/2023	05/07/2023	\$ (13 231)	\$ (13 250)	(1,36)	
TDM	5,180	28/06/2023	12/07/2023	(2 126)	(2 126)	(0,22)	
	5,200	29/06/2023	13/07/2023	(7 703)	(7 705)	(0,79)	
Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos					\$ (23 081)	(2,37)	

⁽¹⁾ Le montant à payer sur les opérations par vente et rachat dos-à-dos comprend 24 \$ de baisse de prix différée.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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)	\$ 10	\$ 6	\$ S/O	\$ S/O	\$ S/O
BOA	1 237	(980)	257	(97)	0	(97)
BPS	1 329	480	1 809	(3 167)	4 390	1 223
BRC	6	0	6	311	(320)	(9)
CBK	(4 803)	7 320	2 517	2 368	(1 310)	1 058
CIB	(818)	1 280	462	(334)	470	136
CKL	(15)	0	(15)	(14)	0	(14)
DUB	(1 480)	1 190	(290)	(1 532)	1 480	(52)
FAR	(492)	670	178	S/O	S/O	S/O
FBF	(380)	430	50	(181)	80	(101)
GLM	(70)	70	0	(384)	260	(124)
GSC	S/O	S/O	S/O	(3)	0	(3)
GST	(6 441)	10 230	3 789	(3 474)	4 890	1 416
HUS	(10)	0	(10)	(10)	0	(10)
JPM	(1 118)	3 150	2 032	(272)	1 520	1 248
MAC	(856)	1 470	614	1 137	(840)	297
MBC	(2 962)	2 240	(722)	(3 160)	2 770	(390)
MEI	(527)	830	303	(251)	320	69
MYC	S/O	S/O	S/O	(26)	260	234
MYI	450	(460)	(10)	(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	(44)	0	(44)	4 186	(4 010)	176
SOG	(2 455)	2 010	(445)	(497)	570	73
TOR	(9)	0	(9)	S/O	S/O	S/O
UAG	(289)	290	1	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	122,37	108,79
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	20,43	18,76
Autres valeurs mobilières	0,03	0,26
Fonds d'investissement	0,01	0,01
Contrats de mise en pension	0,25	4,32
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,19	0,64
Instruments financiers dérivés compensés	(0,18)	(0,43)
Instruments financiers dérivés hors cote	(2,03)	(0,56)
Contrats de prise en pension	(34,86)	(31,05)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	(2,37)	(1,31)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	0,73	0,51
Canada	0,25	0,18
Îles Caïmans	4,93	5,01
Danemark	2,48	3,73
France	7,82	5,36
Allemagne	S/O	1,07
Irlande	5,48	4,58
Italie	10,13	6,97
Japon	6,47	4,89
Pays-Bas	S/O	0,03
Nouvelle-Zélande	0,20	0,14
Pérou	0,01	0,04
Qatar	S/O	0,02
Arabie saoudite	S/O	0,02
Espagne	5,24	3,61
Suède	1,35	0,99
Suisse	0,10	S/O
Royaume-Uni	12,43	8,89
États-Unis	84,74	81,68
Instruments à court terme	0,47	0,09
Fonds d'investissement	0,01	0,01
Contrats de mise en pension	0,25	4,32
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,21	0,64
Options vendues		
Options 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	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,18)	(0,43)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,23	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	(0,44)	(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	(1,85)	(0,68)
Contrats de change à terme	(0,55)	(0,62)
Contrats de change à terme couverts	0,60	0,88
Autres actifs et passifs à court terme	(41,07)	(31,79)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES			
ARGENTINE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement argentin 1,000 % éch. 09/07/2029	\$ 13	\$ 4	0,00
3,500 % éch. 09/07/2041	800	258	0,26
Provincia de Buenos Aires 88,734 % éch. 12/04/2025 (a)	ARS 20	0	0,00
Total Argentine		262	0,26
AUSTRALIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Santos Finance Ltd. 3,649 % éch. 29/04/2031	\$ 1 100	914	0,92
Virgin Australia Holdings Pty. Ltd 8,125 % éch. 15/11/2024 ^	377	1	0,00
Total Australie		915	0,92
BERMUDES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Valaris Ltd. 8,375 % éch. 30/04/2030	300	301	0,30
Weatherford International Ltd. 6,500 % éch. 15/09/2028	400	402	0,40
Total Bermudes		703	0,70
BRESIL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Vale Overseas Ltd. 6,875 % éch. 10/11/2039	375	393	0,39
CANADA			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Air Canada Pass-Through Trust 3,300 % éch. 15/07/2031	38	34	0,03
ILES CAÏMANS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,500 % éch. 30/01/2023 ^	600	40	0,04
Sands China Ltd. 4,875 % éch. 18/06/2030	300	267	0,27
Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % éch. 26/04/2024 ^	450	68	0,07
Transocean Titan Financing Ltd. 8,375 % éch. 01/02/2028	300	307	0,30
Wynn Macau Ltd. 5,500 % éch. 01/10/2027	100	89	0,09
Total Îles Caïmans		771	0,77
CHINE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Yango Justice International Ltd. 7,500 % éch. 15/04/2024 ^	200	4	0,01
9,250 % éch. 15/04/2023 ^	200	2	0,00
Total Chine		6	0,01
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031	€ 400	307	0,31
FRANCE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Altice France S.A. 5,125 % éch. 15/07/2029	\$ 725	515	0,52
BNP Paribas S.A. 3,132 % éch. 20/01/2033	600	493	0,49
7,750 % éch. 16/08/2029 (e)(g)	200	194	0,20
Société Générale S.A. 3,337 % éch. 21/01/2033	450	361	0,36
6,691 % éch. 10/01/2034	\$ 500	\$ 509	0,51
Total France		2 072	2,08

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
IRLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % éch. 14/08/2024	1 150	1 106	1,11
ITALIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Intesa Sanpaolo SpA 4,950 % éch. 01/06/2042	200	132	0,13
Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028	€ 300	280	0,28
Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029	400	365	0,37
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % éch. 09/10/2025	200	207	0,21
Total Italie		984	0,99
JAPON			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,133 % éch. 20/07/2033	\$ 500	491	0,49
Nomura Holdings, Inc. 1,851 % éch. 16/07/2025	200	183	0,18
2,999 % éch. 22/01/2032	375	304	0,31
Total Japon		978	0,98
ACTIONS			
LUXEMBOURG			
ACTIONS ORDINAIRES			
Intelsat Emergence S.A. (d)(h)	7 480	172	0,17
VALEUR NOMINALE (en milliers)			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature) 3,000 % éch. 31/12/2026 (c)	\$ 520	308	0,31
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % éch. 15/03/2030	562	513	0,51
		821	0,82
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Intelsat Jackson Holdings S.A. 9,443 % éch. 01/02/2029	139	139	0,14
ACTIONS			
DROITS			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025	1 566	9	0,01
Total Luxembourg		1 141	1,14
VALEUR NOMINALE (en milliers)			
MEXIQUE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Petroleos Mexicanos 10,000 % éch. 07/02/2033	\$ 100	92	0,09
MULTINATIONALES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Delta Air Lines, Inc. 4,750 % éch. 20/10/2028	400	388	0,39
NXP BV 3,250 % éch. 11/05/2041	875	638	0,64
Total Multinationales		1 026	1,03
PAYS-BAS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Prosus NV 3,832 % éch. 08/02/2051	300	184	0,19
AFRIQUE DU SUD			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 26 800	\$ 1 473	1,48

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ESPAGNE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % éch. 08/06/2028	€ 400	374	0,37
SUISSE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Credit Suisse AG 4,713 % éch. 31/05/2024	400	435	0,44
UBS Group AG 4,988 % éch. 05/08/2033	\$ 500	464	0,46
6,442 % éch. 11/08/2028	400	402	0,40
6,537 % éch. 12/08/2033	250	256	0,26
Total Suisse		1 557	1,56
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Barclays PLC 5,746 % éch. 09/08/2033	500	484	0,48
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % éch. 27/01/2029	500	312	0,31
Grainger PLC 3,000 % éch. 03/07/2030	£ 200	193	0,19
HSBC Holdings PLC 4,600 % éch. 17/12/2030 (e)(g)	\$ 300	229	0,23
5,402 % éch. 11/08/2033	250	244	0,24
INEOS Quattro Finance PLC 2,500 % éch. 15/01/2026	€ 100	98	0,10
John Lewis PLC 4,250 % éch. 18/12/2034	£ 300	238	0,24
Market Bidco Finco PLC 4,750 % éch. 04/11/2027	€ 800	705	0,71
National Grid PLC 5,809 % éch. 12/06/2033	\$ 50	51	0,05
Virgin Media Secured Finance PLC 4,125 % éch. 15/08/2030	£ 300	296	0,30
Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % éch. 31/01/2031	€ 375	337	0,34
Total Royaume-Uni		3 187	3,19
ÉTATS-UNIS			
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,975 % éch. 25/12/2045 ^	\$ 277	210	0,21
Argent Securities Trust 5,300 % éch. 25/09/2036	761	251	0,25
5,510 % éch. 25/04/2036	267	88	0,09
5,710 % éch. 25/04/2036	653	216	0,22
Citigroup Mortgage Loan Trust 5,470 % éch. 25/12/2036	1 612	906	0,91
First Franklin Mortgage Loan Trust 6,575 % éch. 25/10/2034	290	289	0,29
GSAMP Trust 5,240 % éch. 25/01/2037	370	216	0,22
5,270 % éch. 25/12/2036	525	258	0,26
5,380 % éch. 25/12/2046	646	326	0,33
MASTR Asset-Backed Securities Trust 5,630 % éch. 25/08/2036	471	185	0,18
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 5,270 % éch. 25/11/2037	69	24	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,280 % éch. 25/01/2037	343	158	0,16
5,290 % éch. 25/10/2036	268	116	0,12
5,450 % éch. 25/09/2036	1 769	666	0,67
5,610 % éch. 25/09/2036	59	26	0,02
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 5,250 % éch. 25/04/2037	61	32	0,03
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 6,465 % éch. 25/09/2046 ^	611	208	0,21

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	DE L'ACTIF NET
6,500 % éch. 25/08/2037 ^	\$ 1 880	\$ 825	0,83	5,500 % éch. 25/08/2035 ^	\$ 19	\$ 15	0,01	ÎLES VIERGES BRITANNIQUES			
7,798 % éch. 25/09/2037	288	242	0,24	5,750 % éch. 25/03/2037 ^	513	375	0,38	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Residential Asset Securitization Trust				Studio City Finance Ltd.			
3,287 % éch. 25/09/2037 ^	70	63	0,06	5,750 % éch. 25/03/2037 ^	227	75	0,08	5,000 % éch. 15/01/2029	\$ 150	\$ 111	0,11
5,750 % éch. 25/07/2037 ^	7	4	0,00	6,000 % éch. 25/02/2036	322	148	0,15				
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				6,250 % éch. 25/11/2036 ^	480	192	0,19				
6,000 % éch. 25/09/2035	229	75	0,08	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust							
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				5,630 % éch. 25/05/2037 ^	75	66	0,07				
2,796 % éch. 29/12/2037	638	353	0,35	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				5,500 % éch. 25/05/2035 ^	1 232	971	0,97				
6,000 % éch. 25/07/2036	144	76	0,08								
6,500 % éch. 25/10/2021 ^	157	10	0,01								
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust											
5,290 % éch. 25/07/2047	13	12	0,01								
5,300 % éch. 25/02/2047	3 165	1 934	1,94								
5,530 % éch. 25/10/2036 ^	171	54	0,05								
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust											
3,238 % éch. 25/08/2035 ^	12	10	0,01								
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust											
4,226 % éch. 25/08/2035 ^	5	4	0,00								
Freddie Mac											
5,992 % éch. 25/11/2055	636	367	0,37								
Impac Secured Assets Trust											
5,450 % éch. 25/11/2036	37	36	0,04								
IndyMac Mortgage Loan Trust											
3,216 % éch. 25/12/2034	239	224	0,22								
3,629 % éch. 25/05/2037 ^	57	48	0,05								
5,650 % éch. 25/02/2037	22	14	0,01								
JPMorgan Mortgage Trust											
6,500 % éch. 25/07/2036 ^	243	98	0,10								
Lehman XS Trust											
5,510 % éch. 25/07/2037 ^	273	251	0,25								
6,050 % éch. 25/08/2047 ^	187	157	0,16								
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust											
3,103 % éch. 25/11/2037	194	128	0,13								
Residential Accredited Loans, Inc. Trust											
4,834 % éch. 25/12/2035 ^	16	13	0,01								
4,873 % éch. 25/07/2035	2	2	0,00								

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	5,160 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 12 600	Billets du Trésor américain 2,000 % échéance 15/08/2025	\$ (12 869)	\$ 12 600	\$ 12 605	12,63
SSB	2,400	30/06/2023	03/07/2023	553	Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	(564)	553	553	0,55
Total des contrats de mise en pension						\$ (13 433)	\$ 13 153	\$ 13 158	13,18

(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 septembre	Court	09/2023	3	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	90	174	0,18
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	53	18	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Court	09/2023	52	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	13	(26)	(0,03)
				\$ 513	0,51

OPTIONS VENDUES

OPTIONS 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	2	\$ (1)	\$ (1)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	2	(1)	0	0,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (suite)

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	\$ 123,000	21/07/2023	1	\$ 1	\$ 0	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	131,000	21/07/2023	1	(1)	0	0,00
				\$ (2)	\$ (1)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					\$ 512	0,51

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
AutoZone, Inc.	(1,000) %	20/06/2024	\$ 1 400	\$ 26	0,03
Bath & Body Works, Inc.	(1,000)	20/12/2023	350	(28)	(0,03)
ConocoPhillips	(1,000)	20/12/2024	100	(1)	0,00
Johnson Controls International PLC	(1,000)	20/12/2024	1 500	36	0,04
Lowe's Cos., Inc.	(1,000)	20/12/2023	700	14	0,01
Tyson Foods, Inc.	(1,000)	20/06/2024	1 400	30	0,03
				\$ 77	0,08

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	1	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20/12/2024	100	(1)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2025	€ 100	20	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2025	200	15	0,02
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20/06/2028	\$ 300	1	0,00
Toll Brothers Finance Corp.	1,000	20/06/2026	200	3	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2028	100	0	0,00
				\$ 41	0,04

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-40 à 5 ans	(1,000) %	20/06/2028	\$ 2 700	\$ (19)	(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	3,250 %	20/09/2053	£ 100	\$ 7	0,01
À recevoir ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	200	16	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/09/2027	¥ 94 200	6	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	\$ 200	(2)	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,250	21/12/2027	CNY 29 000	(51)	(0,05)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,300	28/04/2027	ZAR 15 500	33	0,03
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	17/03/2053	€ 440	207	0,20
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	300	1	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	600	(2)	0,00
					\$ 215	0,21
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 314	0,31

⁽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.

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 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021 %	25/10/2023	1 500	\$ 86	\$ 380	0,38

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	3,380 %	31/07/2023	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	3,780	31/07/2023	100	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	25/10/2023	7 500	(86)	(675)	(0,68)
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	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	10/07/2023	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	3,250	20/07/2023	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	3,650	20/07/2023	100	0	(1)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	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	10/07/2023	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	3,270	24/07/2023	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	3,670	24/07/2023	100	0	0	0,00
							\$ (91)	\$ (677)	(0,68)

⁽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 mexicain	(1,000) %	20/12/2023	\$ 2 200	\$ 25	\$ (35)	\$ (10)	(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
BRC	Pertamina Persero PT	1,000 %	20/12/2024	\$ 100	\$ 0	\$ 1	\$ 1	0,00

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
CBK	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000 %	20/12/2023	\$ 100	\$ 10	\$ (7)	\$ 3	0,00
GST	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	200	23	(18)	5	0,01
JPM	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	300	39	(32)	7	0,01
					\$ 72	\$ (57)	\$ 15	0,02

⁽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 ET 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
BPS	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid High Yield Index	S/O	1,084 %	\$ 4 800	20/03/2024	\$ 58	\$ (51)	\$ 7	0,01

Tableau des investissements Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond 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	07/2023	AUD	46	\$ 31	\$ 0	\$ 0	0,00	
	08/2023	\$	31	AUD 46	0	0	0,00	
BOA	07/2023		535	¥ 77 192	0	0	0,00	
	09/2023		30	IDR 455 342	0	0	0,00	
BPS	07/2023	AUD	33	\$ 22	0	0	0,00	
	07/2023	\$	3 155	€ 2 879	0	(14)	(0,01)	
	07/2023		984	¥ 136 749	0	(38)	(0,04)	
	08/2023	CNH	471	\$ 68	3	0	0,00	
	08/2023	€	2 879	\$ 3 159	14	0	0,01	
	08/2023	\$	22	AUD 33	0	0	0,00	
	08/2023	ZAR	6 873	\$ 373	11	0	0,01	
	09/2023	\$	30	IDR 443 820	0	0	0,00	
	10/2023	ZAR	4 960	\$ 267	7	0	0,01	
BRC	08/2023	\$	266	COP 1 134 924	2	0	0,00	
	08/2023	ZAR	1 862	\$ 101	3	0	0,00	
	09/2023	IDR	1 771	0	0	0	0,00	
	09/2023	\$	52	PEN 190	0	0	0,00	
CBK	07/2023	€	262	\$ 281	0	(5)	0,00	
	07/2023	PEN	2 936	756	0	(55)	(0,05)	
	07/2023	\$	1 108	PEN 4 093	22	0	0,02	
	08/2023	CLP	177 617	\$ 216	0	(3)	0,00	
	08/2023	\$	217	CLP 177 617	3	0	0,00	
	08/2023		85	NOK 887	0	(2)	0,00	
DUB	07/2023	PEN	4 000	\$ 1 097	0	(6)	(0,01)	
	07/2023	\$	129	BRL 701	16	0	0,02	
	07/2023		547	PEN 2 000	5	0	0,00	
	10/2023	ZAR	2 201	\$ 121	6	0	0,01	
GLM	07/2023	BRL	704	146	0	0	0,00	
	07/2023	PEN	736	201	0	(1)	0,00	
	07/2023	\$	14	PEN 51	0	0	0,00	
	08/2023		106	NOK 1 128	0	(1)	0,00	
	08/2023		99	PEN 362	0	0	0,00	
	09/2023		146	BRL 711	0	0	0,00	
	09/2023		132	PEN 485	1	0	0,00	
	10/2023	ZAR	2 847	\$ 152	3	0	0,00	
JPM	07/2023	¥	46 569	326	3	0	0,00	
	07/2023	MXN	52	3	0	0	0,00	
	08/2023	CNH	223	32	1	0	0,00	
	08/2023	\$	326	¥ 46 371	0	(3)	0,00	
	08/2023		39	NOK 416	0	0	0,00	
	08/2023		101	ZAR 1 856	0	(4)	0,00	
	09/2023		13	IDR 192 077	0	0	0,00	
	09/2023		164	INR 13 526	0	0	0,00	
MBC	07/2023	£	562	\$ 696	0	(19)	(0,02)	
MYI	07/2023	IDR	120 037	8	0	0	0,00	
	07/2023	\$	29	€ 27	0	0	0,00	
	07/2023		8	IDR 120 037	0	0	0,00	
	09/2023		45	665 056	0	0	0,00	
	09/2023		35	INR 2 921	0	0	0,00	
RBC	07/2023		22	MXN 415	3	0	0,00	
	08/2023		468	8 114	1	0	0,00	
SCX	07/2023	AUD	68	\$ 45	0	0	0,00	
	08/2023	CNH	106	15	1	0	0,00	
	08/2023	\$	45	AUD 68	0	0	0,00	
	09/2023		182	IDR 2 714 606	0	(2)	0,00	
	09/2023		103	INR 8 459	0	0	0,00	
	09/2023		98	PEN 360	1	0	0,00	
SOG	07/2023	€	2 617	\$ 2 815	0	(41)	(0,04)	
	07/2023	\$	105	AUD 161	2	0	0,00	
SSB	07/2023		548	PEN 2 000	3	0	0,00	
	08/2023	PEN	2 000	\$ 548	0	(3)	0,00	
TOR	07/2023	AUD	83	55	0	0	0,00	
	07/2023	\$	56	AUD 85	1	0	0,00	
	07/2023		714	£ 562	0	0	0,00	
	08/2023	£	562	\$ 714	0	0	0,00	
	08/2023	\$	55	AUD 83	0	0	0,00	
UAG	07/2023	AUD	40	\$ 27	0	0	0,00	
	07/2023	\$	19	AUD 29	0	0	0,00	
	08/2023		27	40	0	0	0,00	
	08/2023	ZAR	5 607	\$ 292	0	(3)	0,00	
	09/2023		3 978	227	19	0	0,02	
					\$ 131	\$ (200)	\$ (69)	(0,07)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$ 103	CHF 93	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07/2023	CHF 4 184	\$ 4 678	2	0	2	0,00
	07/2023	\$ 6 696	CHF 6 058	75	0	75	0,08
	08/2023	4 678	4 172	0	(2)	(2)	0,00
DUB	07/2023	CHF 1 356	\$ 1 499	0	(17)	(17)	(0,02)
MYI	07/2023	21	24	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	\$ 4 949	CHF 4 447	21	0	21	0,02
UAG	07/2023	CHF 4 315	\$ 4 813	0	(9)	(9)	(0,01)
	07/2023	\$ 4 464	CHF 4 011	19	0	19	0,02
	08/2023	4 813	4 302	10	0	10	0,01
				\$ 127	\$ (28)	\$ 99	0,10

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 35	\$ 38	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 9 060	€ 8 430	138	0	138	0,14
BPS	07/2023	€ 8 985	\$ 9 844	42	0	42	0,04
	07/2023	\$ 9 091	€ 8 456	134	0	134	0,13
	08/2023	9 791	8 923	0	(43)	(43)	(0,04)
CBK	07/2023	€ 8 930	\$ 9 709	1	(34)	(33)	(0,03)
	07/2023	\$ 154	€ 143	2	0	2	0,00
	08/2023	9 644	8 858	33	0	33	0,03
JPM	07/2023	€ 8 912	\$ 9 731	8	0	8	0,01
	08/2023	\$ 9 745	€ 8 912	0	(8)	(8)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 68	\$ 73	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 83	€ 77	1	0	1	0,00
MYI	07/2023	1 533	1 413	8	0	8	0,01
SOG	07/2023	9 047	8 410	128	0	128	0,13
				\$ 495	\$ (86)	\$ 409	0,41

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 155 0,16

Total des Investissements

\$ 113 894 114,13

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (14 098) (14,13)

Actifs nets

\$ 99 796 100,00

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) 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	172	0,17
		\$ 813	\$ 235	0,23

Un montant en numéraire de 1 387 \$ (31 décembre 2022 : 1 243 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 300 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 2023.

Tableau des investissements Fonds PIMCO Credit Opportunities 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 30 juin 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	\$	2	\$	88 633	\$	1 395	\$ 90 030
Fonds d'investissement		9 730		0		0	9 730
Contrats de mise en pension		0		13 153		0	13 153
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾		4		977		0	981
Totaux	\$	9 736	\$	102 763	\$	1 395	\$ 113 894

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$	(14)	\$	(14)
BOA		(158)		300		(104)		(104)
BPS		198		(260)		(290)		0
BRC		6		0		5		5
CBK		(45)		0		(550)		5
DUB		4		0		(40)		(36)
GLM		2		0		(23)		(23)
GST		5		0		9		9
JPM		3		0		(63)		(63)
MBC		(19)		0		(19)		120
MYC		S/O		S/O		(5)		(5)
MYI		8		(50)		(42)		4
RBC		4		0		3		3
SCX		21		0		21		253
SOG		89		0		89		S/O
TOR		1		0		1		S/O
UAG		36		0		(8)		(8)

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	42,31	40,41
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	47,90	40,99
Autres valeurs mobilières	0,01	1,15
Fonds d'investissement	9,75	9,93
Contrats de mise en pension	13,18	7,11
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,51	0,41
Instruments financiers dérivés compensés	0,31	(0,43)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,16	0,46

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Argentine	0,26	0,24
Australie	0,92	0,90
Bermudes	0,70	S/O
Brésil	0,39	0,41
Canada	0,03	0,94
Îles Caïmans	0,77	0,64

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Chine	0,01	0,02
République tchèque	0,31	S/O
France	2,08	1,06
Irlande	1,11	S/O
Italie	0,99	0,34
Japon	0,98	0,80
Luxembourg	1,14	1,17
Mexique	0,09	S/O
Multinationales	1,03	1,02
Pays-Bas	0,19	0,95
Pérou	S/O	0,74
Qatar	S/O	0,40
Afrique du Sud	1,48	1,71
Espagne	0,37	0,37
Suisse	1,56	1,08
Royaume-Uni	3,19	3,36
États-Unis	71,62	65,91
Îles Vierges britanniques	0,11	0,23
Instruments à court terme	0,89	0,26
Fonds d'investissement	9,75	9,93
Contrats de mise en pension	13,18	7,11
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,51	0,41
Options vendues		
Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,08	0,08
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,04	0,04
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,02)	S/O
Swaps de taux d'intérêt	0,21	(0,55)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,38	0,63
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,68)	(1,06)
Options sur titres	S/O	(0,01)
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	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,02	0,03
Swaps de rendement total sur indices	0,01	(0,16)
Contrats de change à terme	(0,07)	(0,04)
Contrats de change à terme couverts	0,51	1,08
Autres actifs et passifs à court terme	(14,13)	(0,03)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Diversified 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				COLOMBIE			
ALBANIE				Avolon Holdings Funding Ltd.				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				2,528 % éch. 18/11/2027 \$ 12 810 \$ 10 814 0,14				Ecopetrol S.A.			
Obligation internationale du gouvernement albanais				2,875 % éch. 15/02/2025 9 400 8 747 0,11				5,875 % éch. 28/05/2045 \$ 200 \$ 137 0,00			
3,500 % éch. 16/06/2027 € 16 800 \$ 16 928 0,21				3,250 % éch. 15/02/2027 4 900 4 370 0,06				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
ARGENTINE				4,250 % éch. 15/04/2026 3 600 3 356 0,04				Obligation internationale du gouvernement colombien			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				5,250 % éch. 15/05/2024 1 200 1 179 0,01				5,000 % éch. 15/06/2045 49 920 34 878 0,44			
Obligation internationale du gouvernement argentin				5,500 % éch. 15/01/2026 10 500 10 180 0,13				5,625 % éch. 26/02/2044 3 100 2 316 0,03			
1,500 % éch. 09/07/2035 \$ 26 928 8 122 0,10				Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature)				Total Colombie			
3,500 % éch. 09/07/2041 133 299 42 925 0,54				9,000 % éch. 22/04/2027 (a) 1 468 1 417 0,02				37 331 0,47			
Total Argentine				Gaci First Investment Co.				CHYPRE			
51 047 0,64				4,875 % éch. 14/02/2035 5 000 4 800 0,06				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AUSTRALIE				5,125 % éch. 14/02/2053 12 100 10 905 0,14				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Kaisa Group Holdings Ltd.				Atrium Finance PLC			
CIMIC Finance Ltd.				9,375 % éch. 30/06/2024 ^ 9 850 655 0,01				2,625 % éch. 05/09/2027 € 19 800 15 749 0,20			
1,500 % éch. 28/05/2029 € 100 86 0,00				4,875 % éch. 28/09/2023 ^ 22 900 1 532 0,02				DANEMARK			
Pacific National Finance Pty. Ltd.				10,500 % éch. 15/01/2025 ^ 21 600 1 445 0,02				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
4,750 % éch. 22/03/2028 \$ 1 000 909 0,01				10,875 % éch. 23/07/2023 ^ 5 800 370 0,00				TDC Net A/S			
Santos Finance Ltd.				11,250 % éch. 16/04/2025 ^ 17 000 1 137 0,01				5,056 % éch. 31/05/2028 12 000 12 870 0,16			
3,649 % éch. 29/04/2031 3 200 2 659 0,03				11,500 % éch. 30/01/2023 ^ 900 60 0,00				RÉPUBLIQUE DOMINICAINE			
Woodside Finance Ltd.				11,650 % éch. 01/06/2026 ^ 9 300 622 0,01				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
3,700 % éch. 15/09/2026 600 565 0,01				11,700 % éch. 11/11/2025 ^ 5 750 385 0,00				Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine			
4,500 % éch. 04/03/2029 2 200 2 076 0,03				11,950 % éch. 12/11/2023 ^ 4 400 358 0,00				6,500 % éch. 15/02/2048 \$ 40 600 35 183 0,44			
Total Australie				Lima Metro Line Finance Ltd.				ÉQUATEUR			
6 295 0,08				5,875 % éch. 05/07/2034 2 707 2 635 0,03				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
BERMUDES				Melco Resorts Finance Ltd.				Obligation internationale du gouvernement d'Équateur			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,875 % éch. 06/06/2025 3 400 3 243 0,04				0,000 % éch. 31/07/2030 (c) 20 689 6 018 0,08			
Aircastle Ltd.				5,375 % éch. 04/12/2029 8 900 7 394 0,09				1,500 % éch. 31/07/2040 13 450 4 217 0,05			
2,850 % éch. 26/01/2028 9 900 8 430 0,11				5,750 % éch. 21/07/2028 1 000 885 0,01				5,500 % éch. 31/07/2030 12 800 6 223 0,08			
4,250 % éch. 15/06/2026 1 600 1 508 0,02				MGM China Holdings Ltd.				Total Équateur			
5,250 % éch. 11/08/2025 32 800 31 708 0,40				4,750 % éch. 01/02/2027 400 364 0,00				16 458 0,21			
Bacardi Ltd.				4,500 % éch. 02/05/2026 1 200 507 0,01				ÉGYPTE			
4,700 % éch. 15/05/2028 22 840 22 104 0,28				Park Aerospace Holdings Ltd.				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
NCL Corp. Ltd.				5,500 % éch. 15/02/2024 504 498 0,01				Obligation internationale du gouvernement égyptien			
8,375 % éch. 01/02/2028 1 000 1 046 0,01				Sands China Ltd.				5,625 % éch. 16/04/2030 € 2 550 1 549 0,02			
Total Bermudes				3,350 % éch. 08/03/2029 500 417 0,01				6,375 % éch. 11/04/2031 17 600 10 718 0,14			
64 796 0,82				Seagate HDD Cayman				7,500 % éch. 16/02/2061 \$ 44 000 22 187 0,28			
BRÉSIL				4,125 % éch. 15/01/2031 5 318 4 363 0,06				8,500 % éch. 31/01/2047 9 500 5 072 0,06			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				9,625 % éch. 01/12/2032 8 386 9 263 0,12				Total Égypte			
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				Seazen Group Ltd.				39 526 0,50			
0,000 % éch. 31/07/2023 (c,d) 13 194 34 0,00				4,450 % éch. 13/07/2025 12 500 6 500 0,08				FINLANDE			
CANADA				Sunac China Holdings Ltd.				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,950 % éch. 26/04/2024 ^ 19 200 2 882 0,04				Balder Finland Oyj			
Air Canada Pass-Through Trust				6,500 % éch. 09/07/2023 ^ 4 800 745 0,01				1,000 % éch. 18/01/2027 € 200 165 0,00			
3,300 % éch. 15/07/2031 770 683 0,01				6,500 % éch. 26/01/2026 ^ 300 45 0,00				1,000 % éch. 20/01/2029 300 209 0,01			
4,125 % éch. 15/11/2026 1 094 1 023 0,01				6,650 % éch. 03/08/2024 ^ 5 900 871 0,01				1,375 % éch. 24/05/2030 4 900 3 199 0,04			
5,250 % éch. 01/10/2030 3 086 2 995 0,04				7,000 % éch. 09/07/2025 ^ 7 400 1 119 0,01				2,000 % éch. 18/01/2031 300 196 0,00			
B.C. Unlimited Liability Co.				7,250 % éch. 14/06/2022 ^ 30 400 4 523 0,06				Total Finlande			
4,000 % éch. 15/10/2030 5 000 4 285 0,06				7,500 % éch. 01/02/2024 ^ 5 500 826 0,01				3 769 0,05			
Enbridge, Inc.				7,950 % éch. 11/10/2023 ^ 11 800 1 777 0,02				FRANCE			
5,700 % éch. 08/03/2033 2 000 2 028 0,03				8,350 % éch. 19/04/2023 ^ 1 100 163 0,00				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Fairfax Financial Holdings Ltd.				Trafford Centre Finance Ltd.				Accor S.A.			
2,750 % éch. 29/03/2028 € 21 850 21 477 0,27				5,402 % éch. 28/07/2038 £ 3 700 3 926 0,05				2,375 % éch. 29/11/2028 1 100 1 080 0,01			
4,850 % éch. 17/04/2028 \$ 200 193 0,00				Wynn Macau Ltd.				Altarea S.C.A.			
Open Text Corp.				4,875 % éch. 01/10/2024 \$ 300 293 0,00				1,750 % éch. 16/01/2030 500 381 0,00			
3,875 % éch. 15/02/2028 3 000 2 645 0,03				5,500 % éch. 15/01/2026 7 600 7 068 0,09				1,875 % éch. 17/01/2028 600 530 0,01			
Total Canada				5,625 % éch. 26/08/2028 1 700 1 485 0,02				Altareit S.C.A.			
35 329 0,45				Total Îles Caïmans				2,875 % éch. 02/07/2025 100 101 0,00			
ÎLES CAÏMANS				147 734 1,86				Alicte France S.A.			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				CHILI				3,375 % éch. 15/01/2028 3 100 2 477 0,03			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,000 % éch. 15/07/2029 (h) 10 900 8 566 0,11			
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.				4,250 % éch. 15/10/2029 20 100 15 835 0,20			
6,410 % éch. 16/01/2030 1 350 1 344 0,02				3,650 % éch. 07/05/2030 3 800 3 486 0,04				5,500 % éch. 15/01/2028 \$ 600 454 0,01			
Catamaran CLO Ltd.				GNL Quintero S.A.				BNP Paribas S.A.			
6,373 % éch. 22/04/2030 3 969 3 946 0,05				4,634 % éch. 31/07/2029 3 212 3 126 0,04				1,904 % éch. 30/09/2028 35 700 30 444 0,38			
OZLM Ltd.				Total Chili				5,198 % éch. 10/01/2030 4 000 3 870 0,05			
6,348 % éch. 16/05/2030 3 998 3 970 0,05				6 612 0,08				CGG S.A.			
Venture CLO Ltd.				CHINE				8,750 % éch. 01/04/2027 6 700 5 619 0,07			
6,311 % éch. 07/09/2030 7 475 7 413 0,09				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS							
6,350 % éch. 20/01/2029 5 237 5 201 0,07				Yango Justice International Ltd.							
Vibrant CLO Ltd.				7,500 % éch. 15/04/2024 ^ 28 200 592 0,01							
6,290 % éch. 15/09/2030 1 756 1 736 0,02				7,500 % éch. 17/02/2025 ^ 19 100 167 0,00							
23 610 0,30				7,875 % éch. 04/09/2024 ^ 19 800 297 0,00							
				Total Chine							
				1 056 0,01							

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
Électricité de France S.A.	\$ 5 700	\$ 5 445	0,07	1,750 % éch. 24/11/2028	€ 500	\$ 390	0,00	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.	€ 7 450	\$ 7 975	0,10
4,500 % éch. 21/09/2028				Total Guernesey, Îles Anglo-normandes		21 648	0,27	4,073 % éch. 15/11/2031			
6,900 % éch. 23/05/2053	1 700	1 763	0,02	HONG KONG				CVC Cordatus Loan Fund DAC	13 200	14 131	0,18
9,125 % éch. 15/03/2033 (d)	2 000	2 056	0,03	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,827 % éch. 15/10/2031	1 366	1 466	0,02
La Mondiale SAM				Fortune Star BVI Ltd.				3,937 % éch. 15/04/2032	1 383	1 482	0,02
5,050 % éch. 17/12/2025 (d)	€ 12 665	13 576	0,17	3,950 % éch. 02/10/2026	24 300	18 293	0,23	4,103 % éch. 15/08/2032	2 387	2 555	0,03
Loxam S.A.S.				Huarong Finance Co. Ltd.				Dryden Euro CLO DAC			
2,875 % éch. 15/04/2026	1 600	1 624	0,02	2,125 % éch. 30/09/2023	\$ 3 000	2 965	0,04	3,837 % éch. 15/04/2033	12 800	13 661	0,17
3,750 % éch. 15/07/2026	1 900	1 969	0,03	Total Hong Kong		21 258	0,27	4,183 % éch. 15/05/2034	14 700	15 694	0,20
4,500 % éch. 15/02/2027 (h)	5 500	5 761	0,07	INDONÉSIE				Euro-Galaxy CLO DAC			
New Immo Holding S.A.				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,765 % éch. 11/04/2031	1 281	1 373	0,02
2,750 % éch. 26/11/2026	200	196	0,00	Pertamina Persero PT				3,831 % éch. 24/04/2034	9 600	10 199	0,13
Renault S.A.				6,500 % éch. 07/11/2048	33 400	34 777	0,44	GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC	1 700	1 809	0,02
2,375 % éch. 25/05/2026	18 300	18 511	0,23	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				4,100 % éch. 20/01/2032			
Société Générale S.A.				3,000 % éch. 30/06/2030	17 600	15 071	0,19	Griffith Park CLO DAC			
4,000 % éch. 12/01/2027	\$ 700	653	0,01	6,150 % éch. 21/05/2048	15 000	14 517	0,18	4,103 % éch. 21/11/2031	31 400	33 611	0,42
4,000 % éch. 04/10/2023 (d)(f)	400	389	0,01	ÉMISSIONS SOUVERAINES				Harvest CLO DAC			
7,375 % éch. 18/12/2023 (d)(f)	2 600	2 550	0,03	Obligation internationale du gouvernement indonésien				1,040 % éch. 15/07/2031	1 600	1 591	0,02
TDF Infrastructure SASU				1,400 % éch. 30/10/2031	€ 4 630	4 022	0,05	3,880 % éch. 20/10/2031	18 800	20 093	0,25
1,750 % éch. 01/12/2029	€ 45 500	40 046	0,50	4,850 % éch. 11/01/2033	\$ 2 800	2 793	0,04	3,937 % éch. 15/07/2031	10 400	11 074	0,14
Ubisoft Entertainment S.A.				5,650 % éch. 11/01/2053	1 100	1 154	0,01	4,027 % éch. 15/01/2032	17 600	18 790	0,24
0,878 % éch. 24/11/2027	6 000	5 032	0,06	Total Indonésie		7 969	0,10	4,250 % éch. 26/06/2030	2 393	2 558	0,03
Verrilla S.A.				INTERNATIONALES				Invesco Euro CLO DAC			
1,875 % éch. 10/11/2031	8 100	7 123	0,09	CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				3,827 % éch. 15/07/2031	850	905	0,01
		176 051	2,21	Project Mercury				Jubilee CLO DAC			
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				TBD % éch. 17/07/2030	€ 8 000	8 728	0,11	3,777 % éch. 15/04/2030	4 200	4 476	0,06
Affice France S.A.				IRLANDE				3,787 % éch. 15/04/2030	1 900	2 031	0,03
8,677 % éch. 15/08/2028	3 079	2 938	0,04	TITRES ADRESSÉS À DES ACTIFS				3,827 % éch. 15/04/2031	5 850	6 228	0,08
Total France		178 989	2,25	Accunia European CLO DAC				Laurelin DAC			
ALLEMAGNE				4,107 % éch. 15/10/2030	714	774	0,01	3,920 % éch. 20/10/2031	10 900	11 677	0,15
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Adagio CLO DAC				Madison Park Euro Funding DAC			
Deutsche Bank AG				3,897 % éch. 15/10/2031	5 800	6 206	0,08	3,927 % éch. 15/01/2032	35 500	37 920	0,48
3,035 % éch. 28/05/2032 (g)	\$ 1 100	867	0,01	Ares European CLO				3,977 % éch. 15/07/2032	5 600	5 959	0,08
3,547 % éch. 18/09/2031	19 350	16 081	0,20	Ares European CLO DAC				Man GLG Euro CLO DAC			
3,729 % éch. 14/01/2032 (g)	2 900	2 195	0,03	3,787 % éch. 15/04/2030	298	319	0,00	3,987 % éch. 15/10/2032	5 194	5 520	0,07
3,742 % éch. 07/01/2033	1 900	1 395	0,02	3,837 % éch. 15/10/2030	1 672	1 789	0,02	4,216 % éch. 15/12/2031	10 690	11 451	0,14
5,882 % éch. 08/07/2031	37 300	32 688	0,41	3,837 % éch. 15/10/2030	1 689	1 809	0,02	Oak Hill European Credit Partners DAC			
DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH				3,957 % éch. 15/10/2031	9 900	10 616	0,13	3,930 % éch. 20/01/2032	2 040	2 175	0,03
2,500 % éch. 25/01/2027	€ 1 200	994	0,01	4,050 % éch. 20/04/2032	500	535	0,01	3,940 % éch. 20/10/2031	15 200	16 150	0,20
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				Armada Euro CLO DAC				OCF Euro CLO DAC			
1,625 % éch. 09/07/2024	18 277	18 277	0,23	3,897 % éch. 15/07/2031	11 095	11 842	0,15	3,997 % éch. 15/01/2032	2 961	3 189	0,04
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature)				Aurium CLO DAC				4,091 % éch. 22/09/2034	12 700	13 495	0,17
3,750 % éch. 15/09/2026 (a)	19 950	20 362	0,26	3,907 % éch. 16/01/2031	4 793	5 128	0,06	OLZME DAC			
INEOS Styrolution Group GmbH				4,618 % éch. 23/03/2032	10 400	11 176	0,14	4,088 % éch. 27/07/2032	1 999	2 127	0,03
2,250 % éch. 16/01/2027	19 000	17 812	0,22	Avoca CLO DAC				Palmer Square European Loan Funding DAC			
Volkswagen Bank GmbH				3,997 % éch. 15/10/2032	2 900	3 093	0,04	3,957 % éch. 15/04/2031	5 852	6 272	0,08
2,500 % éch. 31/07/2026	15 800	16 333	0,20	Bain Capital Euro CLO DAC				4,227 % éch. 15/10/2031	4 751	5 106	0,06
ZF Finance GmbH				3,940 % éch. 20/01/2032	5 468	5 834	0,07	Palmerston Park CLO DAC			
2,750 % éch. 25/05/2027	16 200	15 786	0,20	Black Diamond CLO DAC				3,825 % éch. 18/04/2030	994	1 070	0,01
3,750 % éch. 21/09/2028	32 000	31 501	0,40	4,060 % éch. 20/01/2032	2 092	2 250	0,03	Sculptor European CLO DAC			
		174 291	2,19	4,303 % éch. 15/05/2032	4 400	4 696	0,06	3,916 % éch. 14/01/2032	6 700	7 181	0,09
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				Blackrock European CLO DAC				Segovia European CLO DAC			
SCUR-Alpha 1503 GmbH				3,797 % éch. 15/10/2031	10 900	11 620	0,15	4,080 % éch. 20/07/2032	10 100	10 736	0,14
10,602 % éch. 28/03/2030	\$ 2 494	2 366	0,03	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				Tikehau CLO DAC			
Total Allemagne		176 657	2,22	1,050 % éch. 15/01/2031	994	1 000	0,01	4,144 % éch. 04/08/2034	9 400	10 021	0,13
GHANA				3,897 % éch. 15/01/2031	7 755	8 289	0,10	Toro European CLO DAC			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				BNPP AM Euro CLO DAC				3,995 % éch. 12/01/2032	2 500	2 675	0,03
Obligation internationale du gouvernement du Ghana				3,777 % éch. 15/04/2031	1 000	1 067	0,01	4,097 % éch. 15/07/2030	267	290	0,00
8,125 % éch. 26/03/2032 ^	4 200	1 815	0,02	Bridgepoint CLO DAC				4,133 % éch. 15/02/2034	7 650	8 123	0,10
8,750 % éch. 11/03/2061 ^	5 100	2 128	0,03	Cairn CLO DAC					453 190	5,71	
8,950 % éch. 26/03/2051 ^	5 600	2 348	0,03	3,957 % éch. 15/10/2031	8 600	9 197	0,12	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Total Ghana		6 291	0,08	Carlyle Euro CLO DAC				ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC			
GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				2,900 % éch. 15/01/2031	11 548	12 335	0,16	2,700 % éch. 11/06/2023 ^	26 550	4 345	0,05
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,953 % éch. 15/08/2030	4 392	4 684	0,06	AerCap Ireland Capital DAC			
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				4,213 % éch. 15/08/2032	4 400	4 693	0,06	3,150 % éch. 15/02/2024	\$ 12 900	12 658	0,16
2,950 % éch. 29/07/2026	€ 7 400	6 086	0,08					4,625 % éch. 15/10/2027	34 750	32 958	0,42
3,000 % éch. 29/03/2025	16 606	14 992	0,19					Bank of Ireland Group PLC			
Sirius Real Estate Ltd.								6,253 % éch. 16/09/2026	10 600	10 534	0,13
1,125 % éch. 22/06/2026	200	180	0,00					SMBC Aviation Capital Finance DAC			
								2,300 % éch. 15/06/2028	900	767	0,01
								Total Irlande		61 262	0,77
										514 452	6,48

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
4,500 % éch. 01/03/2025	€ 1 808	\$ 1 955	0,03	4,650 % éch. 09/04/2024 ^	\$ 3 200	\$ 192	0,00	CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
United Group BV				MMK International Capital DAC				Grifols S.A.			
3,625 % éch. 15/02/2028	1 600	1 389	0,02	4,375 % éch. 13/06/2024 ^	8 600	516	0,01	5,633 % éch. 15/11/2027	€ 1 296	\$ 1 393	0,02
5,250 % éch. 01/02/2030	8 600	7 447	0,09			2 052	0,02	Total Espagne		77 364	0,97
Volkswagen International Finance NV				ÉMISSIONS SOUVERAINES				SRI LANKA			
3,500 % éch. 17/06/2025 (d)	10 100	10 365	0,13	Obligation internationale du gouvernement russe				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
		229 948	2,90	2,875 % éch. 04/12/2025 ^	€ 7 700	4 893	0,06	Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka			
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				4,250 % éch. 23/06/2027 ^	\$ 13 800	6 011	0,08	7,550 % éch. 28/03/2030 ^	\$ 16 800	7 735	0,10
WP/AP Telecom Holdings BV				4,750 % éch. 27/05/2026 ^	200	101	0,00	7,850 % éch. 14/03/2029 ^	5 800	2 670	0,03
7,498 % éch. 30/03/2029	39 000	42 068	0,53	5,250 % éch. 23/06/2047 ^	3 200	1 424	0,02	Total Sri Lanka		10 405	0,13
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				5,250 % éch. 23/06/2047 ^	28 000	1 680	0,02	SUÈDE			
EMF-NL BV						14 109	0,18	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
3,977 % éch. 17/04/2041	21	22	0,00	Total Russie		16 161	0,20	Castellum AB			
Eurosail BV				ARABIE SAOUDITE				0,750 % éch. 04/09/2026	€ 200	180	0,00
4,677 % éch. 17/10/2040	99	108	0,00	ÉMISSIONS SOUVERAINES				Sagax AB			
		130	0,00	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite				2,000 % éch. 17/01/2024	119	127	0,00
Total Pays-Bas		272 146	3,43	3,450 % éch. 02/12/2061	34 500	24 328	0,31	2,250 % éch. 13/03/2025	400	412	0,01
NIGERIA				4,875 % éch. 18/07/2033	20 000	20 004	0,25	Volvo Car AB			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				5,000 % éch. 18/01/2053	20 000	18 555	0,23	4,250 % éch. 31/05/2028 (h)	29 900	31 394	0,39
Obligation internationale du gouvernement nigérian				Total Arabie saoudite		62 887	0,79	Total Suède		32 113	0,40
7,143 % éch. 23/02/2030	\$ 8 200	6 895	0,09	SERBIE				SUISSE			
7,625 % éch. 28/11/2047	17 700	12 634	0,16	ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
7,875 % éch. 16/02/2032	23 600	19 851	0,25	Obligation internationale du gouvernement serbe				Credit Suisse AG			
Total Nigeria		39 380	0,50	1,650 % éch. 03/03/2033	€ 8 900	6 480	0,08	6,500 % éch. 08/08/2023 (f)	\$ 57 800	57 590	0,73
OMAN				6,500 % éch. 26/09/2033	\$ 9 400	9 242	0,12	UBS Group AG			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Total Serbie		15 722	0,20	3,869 % éch. 12/01/2029	300	271	0,00
Obligation internationale du gouvernement omanais				SINGAPOUR				4,125 % éch. 15/04/2026	15 100	14 410	0,18
6,750 % éch. 17/01/2048	29 300	28 224	0,36	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,194 % éch. 01/04/2031	1 400	1 247	0,02
PANAMA				Flex Ltd.				4,703 % éch. 05/08/2027	1 200	1 147	0,01
ÉMISSIONS SOUVERAINES				3,750 % éch. 01/02/2026	14 000	13 315	0,17	6,442 % éch. 11/08/2028	3 200	3 214	0,04
Obligation internationale du gouvernement panaméen				SLOVÉNIE				6,537 % éch. 12/08/2033	500	513	0,01
6,700 % éch. 26/01/2036	20 600	22 109	0,28	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Suisse		78 392	0,99
PÉROU				Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				TURQUIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				1,875 % éch. 27/01/2025	€ 8 300	8 759	0,11	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement péruvien				Nova Ljubljanska Banka d.d.				Obligation internationale du gouvernement turc			
8,750 % éch. 21/11/2033	15 000	19 062	0,24	3,400 % éch. 05/02/2030	7 100	6 584	0,08	4,875 % éch. 16/04/2043	33 067	21 308	0,27
PHILIPPINES				Total Slovénie		15 343	0,19	5,750 % éch. 11/05/2047	58 300	39 985	0,50
ÉMISSIONS SOUVERAINES				AFRIQUE DU SUD				Total Turquie		61 293	0,77
Obligation internationale du gouvernement philippin				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				UKRAINE			
5,000 % éch. 17/07/2033	2 000	2 028	0,03	AngloGold Ashanti Holdings PLC				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
PORTUGAL				3,750 % éch. 01/10/2030	\$ 2 000	1 718	0,03	NPC Ukrenergo			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Sasol Financing USA LLC				6,875 % éch. 09/11/2028 ^	1 000	215	0,00
Banco Espirito Santo S.A.				5,875 % éch. 27/03/2024	4 100	4 051	0,05	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
4,750 % éch. 15/01/2018 ^	€ 200	53	0,00	ÉMISSIONS SOUVERAINES				State Agency of Roads of Ukraine			
Galp Energia SGPS S.A.				Obligation internationale du gouvernement sud-africain				6,250 % éch. 24/06/2030 ^	1 400	307	0,00
2,000 % éch. 15/01/2026	12 300	12 600	0,16	5,650 % éch. 27/09/2047	13 700	9 725	0,12	Obligation internationale du gouvernement ukrainien			
Total Portugal		12 653	0,16	Total Afrique du Sud		15 494	0,20	4,375 % éch. 27/01/2032 ^	€ 67 619	16 121	0,20
QATAR				ESPAGNE				6,750 % éch. 20/06/2028 ^	6 300	1 477	0,02
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				6,876 % éch. 21/05/2031 ^	\$ 6 400	1 478	0,02
Nakilat, Inc.				ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.				7,375 % éch. 25/09/2034 ^	5 300	1 244	0,02
6,067 % éch. 31/12/2033	\$ 9 944	10 438	0,13	1,375 % éch. 17/06/2025 (h)	€ 700	716	0,01	8,994 % éch. 01/02/2026 ^	8 200	2 075	0,03
ROUMANIE				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.						22 702	0,29
ÉMISSIONS SOUVERAINES				6,000 % éch. 29/03/2024 (d)(f)	2 800	2 963	0,04	Total Ukraine		22 917	0,29
Obligation internationale du gouvernement roumain				6,000 % éch. 15/01/2026 (d)(f)	9 200	9 443	0,12	ÉMIRATS ARABES UNIS			
2,000 % éch. 14/04/2033	€ 1 500	1 159	0,01	6,138 % éch. 14/09/2028	\$ 15 800	15 850	0,20	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
2,875 % éch. 13/04/2042	8 000	5 379	0,07	ÉMISSIONS SOUVERAINES				DAE Sukuk Dfc Ltd.			
6,625 % éch. 27/09/2029	14 500	16 467	0,21	Banco de Sabadell S.A.				3,750 % éch. 15/02/2026	11 800	11 230	0,14
7,625 % éch. 17/01/2053	\$ 3 000	3 305	0,04	5,375 % éch. 08/09/2026	€ 22 100	23 999	0,30	ROYAUME-UNI			
Total Roumanie		26 310	0,33	Banco Santander S.A.				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
RUSSIE				3,490 % éch. 28/05/2030	\$ 1 400	1 222	0,01	AGPS BondCo PLC			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Cellex Finance Co. S.A.				4,625 % éch. 14/01/2026 ^	€ 1 100	468	0,01
ALROSA Finance S.A.				2,000 % éch. 15/09/2032	€ 23 100	19 882	0,25	5,500 % éch. 13/11/2026 ^	2 000	837	0,01
3,100 % éch. 25/06/2027 ^	22 400	1 344	0,01	Lorca Telecom Bondco S.A.				Barclays PLC			
				4,000 % éch. 18/09/2027	1 900	1 896	0,02	0,577 % éch. 09/08/2029	2 500	2 186	0,03
						75 971	0,95	6,125 % éch. 15/12/2025 (d)(f)	\$ 11 100	9 743	0,12
								7,437 % éch. 02/11/2033	8 500	9 201	0,12

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
7,750 % éch. 15/09/2023 (d)(f)	\$ 3 500	\$ 3 438	0,04	ÉTATS-UNIS				5,370 % éch. 25/09/2037 ^	73	73	0,00
BAT International Finance PLC				TITRES ADRESSÉS À DES ACTIFS				5,380 % éch. 25/10/2047	1 052	1 032	0,01
3,950 % éch. 15/06/2025				Accredited Mortgage Loan Trust	\$ 317	\$ 286	0,00	5,450 % éch. 25/03/2047 ^	773	755	0,01
Bellis Acquisition Co. PLC	1 600	1 541	0,02	4,800 % éch. 25/01/2035				5,460 % éch. 25/09/2037 ^	653	539	0,01
3,250 % éch. 16/02/2026	£ 32 400	34 575	0,43	5,410 % éch. 25/09/2036	578	568	0,01	5,630 % éch. 25/02/2037 ^	3 600	3 207	0,04
Greene King Finance PLC				5,870 % éch. 25/09/2035	1 127	1 105	0,01	5,675 % éch. 25/08/2036	4 600	4 383	0,06
5,106 % éch. 15/03/2034	355	398	0,01	6,095 % éch. 25/09/2035	7 750	6 267	0,08	5,750 % éch. 25/06/2036	83	82	0,00
HSBC Holdings PLC				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				5,840 % éch. 25/05/2036	268	263	0,00
2,848 % éch. 04/06/2031	\$ 4 200	3 487	0,04	5,330 % éch. 25/02/2037	3 010	1 306	0,02	5,850 % éch. 25/03/2036 ^	1 386	1 197	0,02
3,973 % éch. 22/05/2030	9 300	8 360	0,10	5,360 % éch. 25/02/2037	3 036	1 342	0,02	5,990 % éch. 25/10/2047	3 720	3 535	0,05
4,950 % éch. 31/03/2030	2 500	2 464	0,03	5,450 % éch. 25/04/2036	251	242	0,00	6,140 % éch. 25/02/2036 ^	10 608	9 235	0,12
Infirma PLC				5,450 % éch. 25/07/2036 ^	11 297	3 154	0,04	6,245 % éch. 25/07/2035	104	103	0,00
1,250 % éch. 22/04/2028	€ 7 500	7 109	0,09	5,460 % éch. 25/08/2036	518	491	0,01	6,725 % éch. 25/11/2034	796	780	0,01
John Lewis PLC				5,470 % éch. 25/08/2036 ^	2 349	598	0,01	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.			
4,250 % éch. 18/12/2034	£ 3 210	2 546	0,03	5,750 % éch. 25/02/2036	447	438	0,01	5,870 % éch. 25/03/2034	34	34	0,00
6,125 % éch. 21/01/2025	5 600	6 859	0,09	5,810 % éch. 25/11/2035	231	232	0,00	6,005 % éch. 25/08/2034	83	82	0,00
Landlease Europe Finance PLC				5,945 % éch. 25/01/2035	604	552	0,01	Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.			
3,500 % éch. 02/12/2033	368	306	0,00	6,050 % éch. 25/12/2034	1 053	944	0,01	5,710 % éch. 25/04/2034	16	14	0,00
Lloyds Banking Group PLC				6,080 % éch. 25/02/2036 ^	69	62	0,00	5,900 % éch. 25/03/2034	21	20	0,00
4,976 % éch. 11/08/2033	\$ 1 300	1 217	0,02	6,125 % éch. 25/06/2034	446	408	0,01	5,950 % éch. 25/08/2047	38	37	0,00
Market Bidco Finco PLC				Aegis Asset-Backed Securities Trust				6,650 % éch. 25/02/2035	125	122	0,00
4,750 % éch. 04/11/2027	€ 19 800	17 444	0,22	5,795 % éch. 25/12/2035	188	169	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
Marks & Spencer PLC				6,150 % éch. 25/03/2035 ^	213	198	0,00	4,599 % éch. 25/01/2032	18	17	0,00
3,750 % éch. 19/05/2026	£ 100	115	0,00	Ameriqst Mortgage Securities Trust				Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
4,500 % éch. 10/07/2027	10 138	11 417	0,14	5,735 % éch. 25/03/2036	1	1	0,00	5,370 % éch. 25/07/2037	180	119	0,00
Mitchells & Butlers Finance PLC				Ameriqst Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through				Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
5,451 % éch. 15/12/2030	3 433	4 048	0,05	Certificats				3,075 % éch. 25/07/2036	3 738	3 483	0,04
6,002 % éch. 15/12/2030	£ 1 384	1 274	0,02	4,039 % éch. 25/11/2034	165	164	0,00	Ellington Loan Acquisition Trust			
6,013 % éch. 15/12/2030	\$ 349	398	0,01	6,020 % éch. 25/07/2034	108	107	0,00	6,200 % éch. 25/05/2037	2 055	1 933	0,02
6,469 % éch. 15/09/2032	1 700	1 885	0,02	6,080 % éch. 25/05/2035	482	473	0,01	EMC Mortgage Loan Trust			
Nationwide Building Society				6,155 % éch. 25/07/2035	3 500	2 924	0,04	6,250 % éch. 25/11/2041	3	2	0,00
4,363 % éch. 01/08/2024	\$ 30 500	30 439	0,38	6,170 % éch. 25/09/2034	798	774	0,01	First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,750 % éch. 20/06/2027 (d)(f)	£ 4 300	4 695	0,06	6,170 % éch. 25/09/2034	92	91	0,00	5,470 % éch. 25/04/2036	120	115	0,00
NatWest Group PLC				6,200 % éch. 25/11/2034	315	309	0,00	5,630 % éch. 25/04/2036	400	357	0,01
4,800 % éch. 05/04/2026	\$ 31 275	30 379	0,38	6,260 % éch. 25/03/2035	200	195	0,00	5,630 % éch. 25/08/2036	147	135	0,00
4,892 % éch. 18/05/2029	17 200	16 380	0,21	Amorizing Residential Collateral Trust				5,870 % éch. 25/10/2035	10	10	0,00
6,000 % éch. 29/12/2025 (d)(f)	17 800	16 509	0,21	6,150 % éch. 25/10/2034	85	84	0,00	6,095 % éch. 25/03/2035	50	49	0,00
Pinnacle Bidco PLC				Argent Securities Trust				6,350 % éch. 25/01/2035	77	76	0,00
5,500 % éch. 15/02/2025	€ 900	946	0,01	5,690 % éch. 25/05/2036	794	197	0,00	6,575 % éch. 25/10/2034	189	188	0,00
6,375 % éch. 15/02/2025	£ 2 200	2 671	0,03	Asset-Backed Funding Certificates Trust				7,025 % éch. 25/07/2034	904	889	0,01
Rolls-Royce PLC				5,260 % éch. 25/01/2037	178	103	0,00	First NLC Trust			
5,750 % éch. 15/10/2027	3 300	3 901	0,05	5,310 % éch. 25/01/2037	619	359	0,01	2,294 % éch. 25/05/2035	182	153	0,00
Santander UK Group Holdings PLC				5,370 % éch. 25/01/2037	206	120	0,00	Fremont Home Loan Trust			
3,823 % éch. 03/11/2028	\$ 18 124	16 330	0,21	6,200 % éch. 25/03/2034 ^	251	234	0,00	5,490 % éch. 25/02/2036	1 764	1 669	0,02
6,750 % éch. 24/06/2024 (d)(f)	£ 11 835	14 114	0,18	6,400 % éch. 25/06/2037	11 869	8 260	0,10	5,490 % éch. 25/02/2037	1 084	372	0,01
Tesco Property Finance PLC				Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				6,080 % éch. 25/06/2035 ^	3 077	2 726	0,03
5,744 % éch. 13/04/2040	1 955	2 308	0,03	6,110 % éch. 25/07/2035	16	16	0,00	GSAA Home Equity Trust			
TP ICAP Finance PLC				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				5,270 % éch. 25/11/2036	409	103	0,00
5,250 % éch. 29/05/2026	5 182	6 070	0,08	4,477 % éch. 25/11/2035 ^	30	28	0,00	5,390 % éch. 25/04/2047	72	67	0,00
Travis Perkins PLC				6,155 % éch. 25/06/2035	504	483	0,01	6,050 % éch. 25/08/2037	45	44	0,00
4,500 % éch. 07/09/2023	2 100	2 648	0,03	6,350 % éch. 25/01/2045	39	39	0,00	GSAMP Trust			
Virgin Media Secured Finance PLC				6,400 % éch. 25/08/2037	320	314	0,00	3,332 % éch. 25/11/2034	351	331	0,00
4,125 % éch. 15/08/2030	27 700	27 318	0,34	Carrington Mortgage Loan Trust				5,200 % éch. 25/12/2046	234	118	0,00
4,250 % éch. 15/01/2030	24 600	24 688	0,31	5,310 % éch. 25/10/2036	720	565	0,01	5,240 % éch. 25/01/2037	270	158	0,00
Virgin Money UK PLC				5,370 % éch. 25/01/2037	1 200	887	0,01	5,290 % éch. 25/12/2036	5 763	3 118	0,04
2,875 % éch. 24/06/2025	€ 21 500	22 733	0,29	5,400 % éch. 25/10/2036	720	565	0,01	5,690 % éch. 25/04/2036	2 908	1 831	0,02
3,125 % éch. 22/06/2025	£ 500	603	0,01	5,410 % éch. 25/02/2037	2 219	2 008	0,03	5,735 % éch. 25/01/2036	99	101	0,00
3,375 % éch. 24/04/2026	1 400	1 621	0,02	5,630 % éch. 25/06/2036	1 969	1 866	0,02	Home Equity Loan Trust			
4,000 % éch. 25/09/2026	4 200	4 829	0,06	Chase Funding Trust				5,490 % éch. 25/04/2037	2 000	1 651	0,02
4,000 % éch. 03/09/2027	4 700	5 231	0,07	6,333 % éch. 25/04/2032	72	69	0,00	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
Vmed O2 UK Financing PLC				Citigroup Mortgage Loan Trust				5,290 % éch. 25/11/2036	294	264	0,00
3,250 % éch. 31/01/2031	€ 7 450	6 696	0,08	5,310 % éch. 25/01/2037	731	248	0,00	5,390 % éch. 25/04/2037	789	515	0,01
4,000 % éch. 31/01/2029	£ 38 700	39 201	0,49	5,350 % éch. 25/05/2037	802	529	0,01	5,530 % éch. 25/06/2036	70	68	0,00
4,500 % éch. 15/07/2031	9 100	8 808	0,11	5,470 % éch. 25/09/2036	598	437	0,01	HSI Asset Securitization Corp. Trust			
		420 434	5,29	5,550 % éch. 25/11/2046	622	596	0,01	5,370 % éch. 25/12/2036	495	135	0,00
				5,570 % éch. 25/12/2036	1 375	1 343	0,02	5,430 % éch. 25/01/2037	2 927	2 036	0,03
				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				5,650 % éch. 25/07/2036	2 482	1 119	0,01
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				5,410 % éch. 25/03/2037	981	830	0,01	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
INEOS Finance PLC				5,885 % éch. 25/09/2035 ^	148	147	0,00	4,459 % éch. 25/01/2037 ^	485	266	0,00
6,168 % éch. 08/11/2028	€ 14 200	15 034	0,19	Countrywide Asset-Backed Certificates				5,340 % éch. 25/03/2047	502	496	0,01
INEOS Quattro Holdings Ltd.				5,650 % éch. 25/01/2046 ^	7 016	6 552	0,08	5,390 % éch. 25/08/2036	294	288	0,00
6,168 % éch. 29/01/2026	4 900	5 175	0,07	6,050 % éch. 25/03/2047 ^	54	45	0,00	5,410 % éch. 25/03/2037	117	114	0,00
		20 209	0,26	6,250 % éch. 25/05/2047 ^	796	604	0,01	5,410 % éch. 25/06/2037	99	98	0,00
Total Royaume-Uni		440 643	5,55	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				5,430 % éch. 25/01/2037	101	101	0,00
				4,473 % éch. 25/07/2036	1 375	1 229	0,02	5,450 % éch. 25/03/2037	4 349	3 907	0,05
				4,473 % éch. 25/07/2036	33	30	0,00	5,555 % éch. 25/07/2036	150	145	0,00
				4,740 % éch. 25/10/2035	0	0	0,00	Lehman ABS Mortgage Loan Trust			
				5,290 % éch. 25/07/2037 ^	487	479	0,01	5,240 % éch. 25/06/2037	247	159	0,00
				5,370 % éch. 25/06/2037	955	915	0,01	5,350 % éch. 25/06/2037	126	82	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
Long Beach Mortgage Loan Trust				5,400 % éch. 25/07/2037	\$ 2 344	\$ 1 507	0,02	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,330 % éch. 25/09/2036	14 143	3 971	0,05	5,430 % éch. 25/07/2036	13 743	7 942	0,10	5,280 % éch. 25/02/2037	9	8	0,00
5,690 % éch. 25/05/2046	2 494	797	0,01	5,690 % éch. 25/01/2036	400	357	0,01	5,380 % éch. 25/01/2037	2 066	1 250	0,02
5,750 % éch. 25/02/2036	11 316	9 307	0,12	5,720 % éch. 25/01/2036	5 043	3 519	0,04	5,490 % éch. 25/12/2036	79	74	0,00
5,795 % éch. 25/11/2035	38	38	0,00	5,915 % éch. 25/08/2035	400	378	0,01	5,490 % éch. 25/12/2036	111	108	0,00
6,200 % éch. 25/06/2035	258	250	0,00	Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates				5,570 % éch. 25/02/2037			
6,425 % éch. 25/02/2035	1 928	1 860	0,02	5,840 % éch. 25/11/2035	421	395	0,01		143	138	0,00
MASTR Asset-Backed Securities Trust				Owinit Mortgage Loan Trust				6,050 % éch. 25/08/2037	36	36	0,00
5,320 % éch. 25/10/2036	3	2	0,00	6,050 % éch. 25/10/2036 ^	126	118	0,00	Structured Asset Securities Corp. Trust	166	157	0,00
5,350 % éch. 25/08/2036	4 991	1 584	0,02	Park Place Securities, Inc.				Truman Capital Mortgage Loan Trust			
5,370 % éch. 25/08/2036	1 922	753	0,01	5,885 % éch. 25/09/2035	183	178	0,00	5,410 % éch. 25/03/2036	374	369	0,01
5,420 % éch. 25/08/2036	3 334	1 359	0,02	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust			
5,450 % éch. 25/03/2036	1 041	928	0,01	5,885 % éch. 25/08/2035	355	341	0,00	5,300 % éch. 25/01/2037	889	733	0,01
5,510 % éch. 25/02/2036	329	134	0,00	5,885 % éch. 25/09/2035	5 817	5 596	0,07	Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust			
5,630 % éch. 25/03/2036	1 017	625	0,01	5,945 % éch. 25/07/2035	94	93	0,00	5,630 % éch. 25/05/2036	658	500	0,01
5,650 % éch. 25/10/2035 ^	288	269	0,00	5,975 % éch. 25/07/2035	400	374	0,01	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5,930 % éch. 25/02/2034	453	436	0,01	6,095 % éch. 25/06/2035	20	20	0,00	5,645 % éch. 25/05/2036	1 966	1 954	0,03
6,050 % éch. 25/04/2034	316	299	0,00	6,200 % éch. 25/10/2034	282	276	0,00	Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
6,050 % éch. 25/10/2035	1 325	1 152	0,02	6,275 % éch. 25/03/2035	255	246	0,00	5,890 % éch. 25/04/2034	150	144	0,00
MASTR Specialized Loan Trust				6,395 % éch. 25/01/2036	78	76	0,00				
6,275 % éch. 25/11/2035	139	129	0,00	6,950 % éch. 25/12/2034	406	399	0,01				
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				People's Choice Home Loan Securities Trust							
5,450 % éch. 25/08/2037	2 723	1 415	0,02	6,500 % éch. 25/01/2035	487	462	0,01				
5,610 % éch. 25/11/2037	2 823	999	0,01	People's Financial Realty Mortgage Securities Trust							
5,870 % éch. 25/05/2036	61	60	0,00	5,290 % éch. 25/09/2036	989	276	0,00				
6,050 % éch. 25/02/2047	105	62	0,00	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust							
6,200 % éch. 25/04/2035	93	87	0,00	5,360 % éch. 25/01/2037	369	356	0,00				
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				5,410 % éch. 25/11/2036	17	17	0,00				
5,220 % éch. 25/10/2036	66	29	0,00	5,735 % éch. 25/02/2036	63	62	0,00				
5,280 % éch. 25/11/2036	307	139	0,00	RAAC Trust							
5,280 % éch. 25/01/2037	883	405	0,01	5,750 % éch. 25/06/2044	52	43	0,00				
5,290 % éch. 25/10/2036	1 928	839	0,01	5,750 % éch. 25/09/2045	83	80	0,00				
5,290 % éch. 25/11/2036	192	91	0,00	5,850 % éch. 25/11/2046	159	148	0,00				
5,290 % éch. 25/05/2037	3 314	2 381	0,03	6,350 % éch. 25/10/2045	14	14	0,00				
5,300 % éch. 25/10/2036	173	91	0,00	6,650 % éch. 25/09/2047	396	378	0,01				
5,300 % éch. 25/11/2036	2 917	1 606	0,02	Renaissance Home Equity Loan Trust							
5,350 % éch. 25/09/2036	3	1	0,00	5,340 % éch. 25/01/2037	1 247	438	0,01				
5,370 % éch. 25/11/2036	240	114	0,00	Residential Asset Mortgage Products Trust							
5,400 % éch. 25/03/2037	910	402	0,01	5,790 % éch. 25/01/2036	423	378	0,01				
5,470 % éch. 25/09/2036	1 173	525	0,01	Residential Asset Securities Corp. Trust							
5,730 % éch. 25/01/2035	686	681	0,01	5,410 % éch. 25/11/2036	243	223	0,00				
5,770 % éch. 25/12/2035	132	126	0,00	5,490 % éch. 25/11/2036	66	62	0,00				
5,795 % éch. 25/09/2035	6	6	0,00	5,710 % éch. 25/04/2036	28	27	0,00				
5,855 % éch. 25/12/2034	82	74	0,00	5,750 % éch. 25/02/2036	130	127	0,00				
5,855 % éch. 25/01/2035	1 380	1 300	0,02	5,780 % éch. 25/12/2035	67	66	0,00				
6,005 % éch. 25/03/2034	371	364	0,01	5,810 % éch. 25/11/2035	25	25	0,00				
6,020 % éch. 25/09/2035	4 281	3 505	0,04	5,810 % éch. 25/12/2035	149	132	0,00				
6,140 % éch. 25/06/2035	961	939	0,01	5,990 % éch. 25/12/2034	5	5	0,00				
6,400 % éch. 25/07/2037	400	335	0,00	Saxon Asset Securities Trust							
7,050 % éch. 25/02/2047	723	605	0,01	5,450 % éch. 25/05/2047	6 331	4 465	0,06				
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				5,615 % éch. 25/03/2036	1 560	1 487	0,02				
5,510 % éch. 25/03/2036	96	77	0,00	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust							
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust				5,330 % éch. 25/07/2036	246	86	0,00				
6,500 % éch. 25/02/2033	227	225	0,00	5,430 % éch. 25/07/2036	707	571	0,01				
6,725 % éch. 25/11/2032	30	29	0,00	5,650 % éch. 25/03/2036	1 244	780	0,01				
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				5,650 % éch. 25/05/2036	254	137	0,00				
5,250 % éch. 25/12/2036	1 436	697	0,01	5,690 % éch. 25/03/2036	110	96	0,00				
5,380 % éch. 25/04/2037	2 390	1 255	0,02	5,810 % éch. 25/08/2035 ^	111	85	0,00				
5,470 % éch. 25/04/2036	67	47	0,00	SG Mortgage Securities Trust							
5,500 % éch. 25/04/2037	16 321	8 582	0,11	5,360 % éch. 25/10/2036	1 500	1 039	0,01				
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				Soundview Home Loan Trust							
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	54	31	0,00	5,270 % éch. 25/11/2036	33	10	0,00				
6,000 % éch. 25/04/2037	10 055	3 681	0,05	5,615 % éch. 25/06/2036 ^	15 486	12 724	0,16				
6,869 % éch. 25/11/2036 ^	223	84	0,00	5,630 % éch. 25/07/2036	200	171	0,00				
New Century Home Equity Loan Trust				Specialty Underwriting & Residential Finance Trust							
5,510 % éch. 25/05/2036	7	7	0,00	3,700 % éch. 25/02/2037 ^	485	189	0,00				
5,870 % éch. 25/03/2035	167	160	0,00	5,420 % éch. 25/04/2037	122	85	0,00				
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				5,450 % éch. 25/11/2037	649	361	0,01				
5,765 % éch. 25/02/2036	2	2	0,00	Structured Asset Investment Loan Trust							
NovaStar Mortgage Funding Trust				5,300 % éch. 25/06/2036	22	21	0,00				
5,250 % éch. 25/03/2037	866	308	0,00	5,300 % éch. 25/09/2036	109	105	0,00				
5,300 % éch. 25/03/2037	1 085	386	0,01	5,750 % éch. 25/01/2036	91	88	0,00				
5,310 % éch. 25/09/2037	1 001	990	0,01	5,825 % éch. 25/11/2035	7 073	6 032	0,08				
5,350 % éch. 25/01/2037	1 022	358	0,01	5,915 % éch. 25/08/2035	4 237	4 017	0,05				
5,570 % éch. 25/01/2037	1 219	427	0,01	6,050 % éch. 25/09/2034	46	45	0,00				
7,025 % éch. 25/03/2035	583	573	0,01	6,080 % éch. 25/01/2035	252	243	0,00				
Option One Mortgage Loan Trust				6,275 % éch. 25/07/2033	20	20	0,00				
5,290 % éch. 25/01/2037	154	88	0,00	6,530 % éch. 25/04/2033	11	10	0,00				
5,320 % éch. 25/05/2037	130	71	0,00								
5,330 % éch. 25/04/2037	454	228	0,00								

ACTIONS

ACTIONS ORDINAIRES
ENERGIE

Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (b)(g)	844 339	92	0,00
--	---------	----	------

VALEUR
NOMINALE
(en milliers)

OBLIGATIONS ET BILLETTS PRIVES

Alaska Airlines Pass-Through Trust			
4,800 % éch. 15/02/2029	\$ 2 492	2 398	0,03
Ally Financial, Inc.			
8,000 % éch. 01/11/2031	12 575	13 056	0,16
American Airlines Pass-Through Trust			
3,000 % éch. 15/04/2030	209	186	0,00
3,150 % éch. 15/08/2033	3 045	2 659	0,03
3,200 % éch. 15/12/2029	3 694	3 315	0,04
3,350 % éch. 15/04/2031	2 699	2 402	0,03
3,375 % éch. 01/11/2028	3 783	3 397	0,04
3,575 % éch. 15/07/2029	2 210	2 051	0,03
3,650 % éch. 15/12/2029	4 182	3 600	0,05
3,650 % éch. 15/08/2030	4 260	3 929	0,05
3,700 % éch. 01/04/2028	3 531	3 179	0,04
American Tower Corp.			
2,950 % éch. 15/01/2051	10 000	6 318	0,08
Amgen, Inc.			
5,250 % éch. 02/03/2033	5 000	5 009	0,06
5,750 % éch. 02/03/2063	2 800	2 843	0,04
Antares Holdings LP			
2,750 % éch. 15/01/2027	2 700	2 221	0,03
AT&T, Inc.			
3,800 % éch. 01/12/2057	12 200	8 843	0,11
Aviation Capital Group LLC			
4,375 % éch. 30/01/2024	800	787	0,01
4,875 % éch. 01/10/2025	600	573	0,01
5,500 % éch. 15/12/2024	8 900	8 716	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
CREDITS CONSORTIAUX ET CESSIIONS				4,009 % éch. 25/03/2036	\$ 282	\$ 169	0,00	6,500 % éch. 25/09/2037 ^	\$ 9 108	\$ 3 744	0,05
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				4,116 % éch. 25/08/2036 ^	245	128	0,00	6,500 % éch. 25/11/2037 ^	807	401	0,01
7,396 % éch. 01/12/2027	\$ 28 435	\$ 28 433	0,36	4,202 % éch. 25/09/2035 ^	65	40	0,00	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
CenturyLink, Inc.				5,470 % éch. 25/01/2047 ^	133	107	0,00	2,948 % éch. 20/10/2035	3	3	0,00
7,467 % éch. 15/03/2027	35 060	27 150	0,34	5,590 % éch. 25/04/2036 ^	72	61	0,00	3,287 % éch. 25/09/2037 ^	36	33	0,00
Charter Communications Operating LLC				6,125 % éch. 25/07/2035	8 500	7 693	0,10	3,367 % éch. 25/10/2035 ^	217	173	0,00
6,795 % - 6,834 % éch. 01/02/2027	48 472	48 240	0,61	Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				3,611 % éch. 25/09/2047 ^	4	3	0,00
CommScope, Inc.				4,098 % éch. 26/01/2036 ^	83	67	0,00	4,006 % éch. 20/12/2035	20	17	0,00
8,443 % éch. 06/04/2026	770	739	0,01	Chase Mortgage Finance Trust				4,085 % éch. 25/03/2037 ^	45	40	0,00
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				3,814 % éch. 25/01/2036 ^	205	176	0,00	4,123 % éch. 20/11/2035 ^	80	66	0,00
6,939 % éch. 22/06/2026	0	0	0,00	3,962 % éch. 25/03/2037 ^	194	180	0,00	4,936 % éch. 25/04/2046 ^	747	238	0,00
INEOS Styrolution U.S. Holding LLC				4,086 % éch. 25/03/2037 ^	45	42	0,00	5,500 % éch. 25/10/2034	384	370	0,01
7,967 % éch. 29/01/2026	9 272	9 264	0,12	5,750 % éch. 25/02/2037	45	13	0,00	5,500 % éch. 25/09/2035 ^	115	105	0,00
Level 3 Financing, Inc.				6,000 % éch. 25/11/2036 ^	57	25	0,00	5,500 % éch. 25/10/2035	47	27	0,00
6,967 % éch. 01/03/2027	17 978	16 792	0,21	6,000 % éch. 25/03/2037 ^	113	61	0,00	5,650 % éch. 25/03/2036	87	71	0,00
Marriott Ownership Resorts, Inc.				ChaseFlex Trust				5,690 % éch. 25/04/2046	7 068	2 057	0,03
6,943 % éch. 29/08/2025	871	871	0,01	5,750 % éch. 25/07/2037	143	118	0,00	5,830 % éch. 25/03/2035 ^	45	40	0,00
Standard Industries, Inc.				6,300 % éch. 25/06/2036 ^	55	47	0,00	6,000 % éch. 25/05/2036 ^	120	57	0,00
7,692 % éch. 22/09/2028	11 255	11 263	0,14	Citicorp Mortgage Securities Trust				6,000 % éch. 25/02/2037 ^	494	357	0,01
Summer (BC) Holdco SARL				6,000 % éch. 25/09/2037	29	27	0,00	6,000 % éch. 25/03/2037 ^	31	14	0,00
7,712 % éch. 04/12/2026	€ 5 000	5 155	0,06	Citigroup Mortgage Loan Trust				6,000 % éch. 25/09/2037 ^	26	14	0,00
Zayo Group Holdings, Inc.				3,018 % éch. 25/09/2037	23	23	0,00	6,250 % éch. 25/09/2036 ^	618	246	0,00
8,217 % éch. 09/03/2027	\$ 600	473	0,01	3,620 % éch. 25/10/2046 ^	60	54	0,00	6,500 % éch. 25/11/2036 ^	164	63	0,00
		148 380	1,87	3,857 % éch. 25/03/2037 ^	2 893	2 502	0,03	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
				3,904 % éch. 25/09/2037 ^	131	114	0,00	4,311 % éch. 25/06/2033	10	9	0,00
				3,974 % éch. 25/09/2037 ^	69	61	0,00	6,000 % éch. 25/01/2036 ^	199	112	0,00
				4,132 % éch. 25/07/2046 ^	166	151	0,00	6,500 % éch. 25/04/2033	0	0	0,00
				4,321 % éch. 25/03/2034	3	3	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				3,616 % éch. 27/09/2035	1 449	1 229	0,02
				4,183 % éch. 25/02/2034	15	15	0,00	3,906 % éch. 28/04/2037	157	145	0,00
				6,080 % éch. 25/09/2035	8	8	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
				CitiMortgage Alternative Loan Trust				6,000 % éch. 25/07/2036	731	385	0,01
				6,000 % éch. 25/01/2037 ^	43	38	0,00	6,000 % éch. 25/04/2037 ^	165	65	0,00
				6,000 % éch. 25/06/2037 ^	526	455	0,01	6,500 % éch. 25/02/2022 ^	616	75	0,00
				Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				6,750 % éch. 25/08/2036 ^	611	333	0,01
				6,000 % éch. 25/05/2036 ^	220	131	0,00	7,000 % éch. 25/08/2037 ^	608	388	0,01
				Countrywide Alternative Loan Trust				Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
				2,748 % éch. 25/02/2036	279	212	0,00	3,631 % éch. 25/10/2043	837	784	0,01
				4,048 % éch. 20/11/2035	274	255	0,00	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
				4,295 % éch. 25/05/2036	166	147	0,00	5,530 % éch. 25/08/2047	93	83	0,00
				5,250 % éch. 25/06/2035 ^	226	175	0,00	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
				5,337 % éch. 20/02/2047 ^	160	125	0,00	5,650 % éch. 25/02/2035	2 715	2 585	0,03
				5,347 % éch. 20/09/2046	128	126	0,00	Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			
				5,367 % éch. 20/07/2046 ^	61	49	0,00	3,746 % éch. 27/11/2036	59	59	0,00
				5,430 % éch. 25/08/2037	340	298	0,01	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
				5,430 % éch. 25/04/2047	4 062	3 619	0,05	5,549 % éch. 25/06/2036 ^	39	31	0,00
				5,456 % éch. 25/01/2036	344	321	0,01	6,250 % éch. 25/08/2037 ^	63	27	0,00
				5,500 % éch. 25/02/2035	896	819	0,01	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
				5,500 % éch. 25/11/2035 ^	362	212	0,00	4,267 % éch. 25/09/2035	279	263	0,01
				5,500 % éch. 25/11/2035	1 349	809	0,01	Greenpoint Mortgage Funding Trust			
				5,500 % éch. 25/12/2035 ^	521	341	0,01	5,550 % éch. 25/10/2046 ^	176	159	0,00
				5,500 % éch. 25/05/2036 ^	307	126	0,00	5,690 % éch. 25/04/2036 ^	82	78	0,00
				5,500 % éch. 25/08/2036 ^	55	25	0,00	GSR Mortgage Loan Trust			
				5,510 % éch. 25/11/2036	31	35	0,00	3,575 % éch. 25/03/2047 ^	259	169	0,00
				5,530 % éch. 25/07/2046 ^	33	32	0,00	3,914 % éch. 25/04/2035	16	14	0,00
				5,530 % éch. 25/09/2046 ^	187	175	0,00	3,935 % éch. 25/01/2036 ^	11	11	0,00
				5,577 % éch. 20/03/2046	81	66	0,00	4,481 % éch. 25/11/2035	41	40	0,00
				5,577 % éch. 20/05/2046 ^	1 346	1 142	0,02	4,662 % éch. 25/09/2035	19	19	0,00
				5,630 % éch. 25/12/2046 ^	2 521	1 605	0,02	4,662 % éch. 25/09/2035	13	13	0,00
				5,650 % éch. 25/06/2035	74	66	0,00	5,490 % éch. 25/12/2034	5	4	0,00
				5,650 % éch. 25/04/2036	3 172	1 195	0,02	5,750 % éch. 25/02/2036	147	127	0,00
				5,670 % éch. 25/07/2035	57	50	0,00	5,750 % éch. 25/03/2036 ^	35	32	0,00
				5,750 % éch. 25/01/2035	183	174	0,00	5,750 % éch. 25/01/2037 ^	92	57	0,00
				5,750 % éch. 25/07/2037	342	208	0,00	6,000 % éch. 25/02/2036 ^	358	183	0,00
				5,770 % éch. 25/08/2035 ^	78	70	0,00	6,500 % éch. 25/09/2036 ^	253	126	0,00
				6,000 % éch. 25/03/2035 ^	4 231	2 043	0,03	6,970 % éch. 25/04/2032	25	21	0,00
				6,000 % éch. 25/02/2036 ^	140	72	0,00	HarborView Mortgage Loan Trust			
				6,000 % éch. 25/03/2036 ^	342	158	0,00	4,063 % éch. 19/06/2036 ^	170	77	0,00
				6,000 % éch. 25/08/2036 ^	154	93	0,00	4,226 % éch. 19/08/2036 ^	42	33	0,00
				6,000 % éch. 25/08/2036 ^	10	6	0,00	4,227 % éch. 19/07/2035 ^	2	2	0,00
				6,000 % éch. 25/08/2036 ^	45	27	0,00	4,688 % éch. 19/08/2036 ^	1	1	0,00
				6,000 % éch. 25/01/2037 ^	521	423	0,01	5,637 % éch. 19/06/2035	219	209	0,00
				6,000 % éch. 25/02/2037 ^	1 993	851	0,01	5,697 % éch. 19/03/2035	20	20	0,00
				6,000 % éch. 25/03/2037 ^	491	197	0,00	5,777 % éch. 19/11/2035	96	69	0,00
				6,000 % éch. 25/04/2037 ^	1 466	727	0,01	5,857 % éch. 19/01/2035	215	190	0,00
				6,000 % éch. 25/05/2037 ^	196	95	0,00	HomeBanc Mortgage Trust			
				6,000 % éch. 25/06/2037 ^	203	98	0,00	5,510 % éch. 25/12/2036	24	23	0,00
				6,000 % éch. 25/08/2037 ^	41	21	0,00	5,650 % éch. 25/03/2035	94	76	0,00
				6,000 % éch. 25/02/2047 ^	310	158	0,00	5,670 % éch. 25/01/2036	105	100	0,00
				6,250 % éch. 25/12/2036 ^	240	113	0,00	HSI Asset Securitization Corp. Trust			
				6,500 % éch. 25/08/2032	13	12	0,00	5,590 % éch. 25/11/2035	1 223	1 144	0,02

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
Impac Secured Assets Trust 5,370 % éch. 25/05/2037 ^	\$ 41	\$ 32	0,00	RBSG Structured Trust 5,500 % éch. 25/11/2035 ^	\$ 74	\$ 62	0,00	4,195 % éch. 25/02/2033	\$ 8	\$ 8	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust 3,103 % éch. 25/06/2037 ^	42	34	0,00	Residential Accredit Loans, Inc. Trust 4,073 % éch. 25/02/2035 ^	49	40	0,00	4,404 % éch. 25/05/2046	64	55	0,00
3,244 % éch. 25/11/2035 ^	26	19	0,00	4,310 % éch. 25/08/2035	981	904	0,01	4,786 % éch. 25/07/2047	443	362	0,01
3,334 % éch. 25/07/2037	48	31	0,00	5,300 % éch. 25/02/2047	719	272	0,01	4,830 % éch. 25/06/2033	30	29	0,00
3,367 % éch. 25/06/2036	109	87	0,00	5,350 % éch. 25/05/2037	323	283	0,01	4,976 % éch. 25/08/2046	274	257	0,00
3,482 % éch. 25/08/2035	611	469	0,01	5,410 % éch. 25/02/2037	5	18	0,00	5,176 % éch. 25/11/2042	3	3	0,00
3,629 % éch. 25/05/2037 ^	144	123	0,00	5,430 % éch. 25/01/2037	89	93	0,00	5,376 % éch. 25/04/2044	1	1	0,00
3,677 % éch. 25/12/2036 ^	58	49	0,00	5,450 % éch. 25/02/2037	226	199	0,00	5,476 % éch. 25/10/2046	17	16	0,00
3,778 % éch. 25/11/2035 ^	455	366	0,01	5,500 % éch. 25/08/2035 ^	406	318	0,01	5,730 % éch. 25/10/2045	26	24	0,00
4,009 % éch. 25/10/2034	228	217	0,00	5,500 % éch. 25/03/2037 ^	71	54	0,00	5,790 % éch. 25/01/2045	291	276	0,01
4,032 % éch. 25/06/2035 ^	155	131	0,00	5,530 % éch. 25/08/2036 ^	111	106	0,00	5,890 % éch. 25/11/2034	272	249	0,00
5,510 % éch. 25/07/2047	171	119	0,00	5,530 % éch. 25/09/2036 ^	428	396	0,01	5,990 % éch. 25/06/2044	243	224	0,00
5,550 % éch. 25/06/2046	546	437	0,01	5,550 % éch. 25/11/2036 ^	144	102	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
5,570 % éch. 25/07/2036	5 363	4 953	0,06	5,580 % éch. 25/05/2046	593	515	0,01	5,470 % éch. 25/02/2037 ^	563	428	0,01
5,630 % éch. 25/07/2035	6	5	0,00	6,000 % éch. 25/09/2035 ^	75	26	0,00	5,500 % éch. 25/05/2036 ^	205	162	0,00
5,750 % éch. 25/07/2035	134	109	0,00	6,000 % éch. 25/06/2036 ^	358	285	0,01	5,500 % éch. 25/07/2035 ^	420	368	0,01
JP Morgan Alternative Loan Trust				6,000 % éch. 25/08/2036 ^	816	667	0,01	5,500 % éch. 25/11/2035 ^	121	104	0,00
3,759 % éch. 25/05/2036 ^	167	99	0,00	6,250 % éch. 25/03/2037 ^	167	128	0,00	6,000 % éch. 25/06/2037 ^	471	425	0,01
4,414 % éch. 25/05/2037 ^	191	174	0,00	6,500 % éch. 25/07/2037 ^	226	182	0,00	Wells Fargo Alternative Loan Trust			
5,470 % éch. 25/10/2036	856	763	0,01	6,500 % éch. 25/09/2037 ^	221	175	0,00	5,750 % éch. 25/07/2037 ^	54	45	0,00
5,843 % éch. 26/05/2037	1 590	1 201	0,02	Residential Asset Securitization Trust				Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
JP Morgan Mortgage Trust				5,500 % éch. 25/09/2035 ^	83	42	0,00	4,417 % éch. 25/11/2037 ^	72	62	0,00
3,636 % éch. 25/10/2036 ^	259	192	0,00	5,500 % éch. 25/12/2035 ^	203	100	0,00	4,563 % éch. 25/12/2036 ^	55	54	0,00
3,909 % éch. 25/11/2035 ^	28	24	0,00	6,500 % éch. 25/04/2037 ^	1 211	350	0,01	4,662 % éch. 25/04/2036 ^	8	7	0,00
3,909 % éch. 25/11/2035 ^	74	63	0,00	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				4,678 % éch. 25/04/2036 ^	150	141	0,00
3,928 % éch. 25/08/2035	23	22	0,00	6,000 % éch. 25/10/2036 ^	106	81	0,00	6,000 % éch. 25/06/2037 ^	1 900	1 667	0,02
4,078 % éch. 25/01/2035 ^	129	104	0,00	6,000 % éch. 25/06/2037 ^	69	51	0,00	6,000 % éch. 25/06/2037 ^	36	32	0,00
4,289 % éch. 25/06/2037 ^	164	127	0,00	Sequoia Mortgage Trust							
4,289 % éch. 25/06/2037 ^	39	30	0,00	3,271 % éch. 20/01/2047 ^	4	3	0,00				
4,366 % éch. 25/07/2035	10	10	0,00	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
4,399 % éch. 25/04/2035	10	10	0,00	3,525 % éch. 25/11/2035 ^	22	19	0,00	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			
6,000 % éch. 25/01/2036 ^	95	48	0,00	3,665 % éch. 25/09/2035	20	14	0,00	5,500 % éch. 01/12/2052	15 643	15 590	0,20
6,500 % éch. 25/07/2036 ^	243	98	0,00	4,082 % éch. 25/10/2036 ^	78	45	0,00	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
Lehman XS Trust				4,455 % éch. 25/09/2035	69	62	0,00	5,000 % éch. 01/07/2053	154 300	151 216	1,90
5,510 % éch. 25/12/2036	2 102	2 039	0,03	4,605 % éch. 25/11/2036 ^	335	285	0,01	5,500 % éch. 01/08/2053	147 900	147 172	1,85
5,550 % éch. 25/03/2047	4 053	3 906	0,05	4,702 % éch. 25/04/2035	9	9	0,00	6,000 % éch. 01/08/2053	64 200	64 757	0,82
5,610 % éch. 25/04/2046 ^	5	6	0,00	5,375 % éch. 25/02/2035	150	143	0,00	6,500 % éch. 01/08/2053	95 300	97 251	1,22
5,630 % éch. 25/09/2046 ^	10	12	0,00	5,470 % éch. 25/10/2035	65	59	0,00				
5,670 % éch. 25/02/2046 ^	191	169	0,00	5,590 % éch. 25/06/2037	106	94	0,00	OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
6,050 % éch. 25/08/2047 ^	421	353	0,01	7,119 % éch. 25/10/2037 ^	69	61	0,00	Obligations du Trésor américain			
6,850 % éch. 25/10/2037	1 839	1 635	0,02	Structured Asset Mortgage Investments Trust				4,000 % éch. 15/11/2042	98 500	97 915	1,23
Luminant Mortgage Trust				5,330 % éch. 25/09/2047	36	33	0,00	Total États-Unis		2 238 376	28,18
5,550 % éch. 25/10/2046	863	770	0,01	5,340 % éch. 25/09/2047	398	359	0,01	VENEZUELA			
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				5,510 % éch. 25/07/2046	130	108	0,00	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
4,560 % éch. 21/11/2034	49	46	0,00	5,530 % éch. 25/06/2036	48	46	0,00	Petroleos de Venezuela S.A.			
5,750 % éch. 25/05/2047 ^	4	4	0,00	5,570 % éch. 25/04/2036	34	30	0,00	6,000 % éch. 16/05/2024 ^	8 400	326	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				5,570 % éch. 25/05/2036	30	20	0,00	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
5,370 % éch. 25/03/2037	224	57	0,00	5,750 % éch. 25/08/2036 ^	393	279	0,01	Obligation internationale du gouvernement vénézuélien			
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				5,806 % éch. 19/10/2034	24	22	0,00	6,000 % éch. 09/12/2020 ^	2 651	166	0,00
3,612 % éch. 25/02/2036	13	12	0,00	5,846 % éch. 19/03/2034	3	3	0,00	7,000 % éch. 31/03/2038 ^	16 792	1 469	0,02
3,738 % éch. 25/03/2036 ^	332	187	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				9,250 % éch. 07/05/2028 ^	7 813	703	0,01
4,120 % éch. 25/11/2035	88	85	0,00	6,639 % éch. 25/06/2033	4	4	0,00				
4,459 % éch. 25/05/2036	129	117	0,00	SunTrust Alternative Loan Trust							
5,610 % éch. 25/04/2029	13	12	0,00	5,750 % éch. 25/12/2035 ^	143	118	0,00				
5,810 % éch. 25/11/2029	3	2	0,00	5,750 % éch. 25/12/2035 ^	165	141	0,00	Total Venezuela		2 664	0,03
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust				Thornburg Mortgage Securities Trust				INSTRUMENTS À COURT TERME			
3,673 % éch. 25/04/2037 ^	21	18	0,00	3,018 % éch. 25/09/2037	16	15	0,00	BILLETS À COURT TERME			
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				Towd Point Mortgage Trust				Corestate Capital Holding S.A.			
4,208 % éch. 25/09/2035 ^	147	53	0,00	2,750 % éch. 25/06/2057	578	545	0,01	15,000 % éch. 31/07/2023 (g)	€ 1 700	1 873	0,02
4,271 % éch. 25/05/2036 ^	380	223	0,00	Wachovia Mortgage Loan Trust LLC				Federal Home Loan Bank			
5,410 % éch. 25/03/2036	53	37	0,00	4,291 % éch. 20/10/2035 ^	36	34	0,00	5,170 % éch. 29/11/2023	\$ 158 500	158 567	2,00
5,470 % éch. 25/01/2035	16	14	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Total des Instruments à court terme		160 440	2,02
5,547 % éch. 25/06/2036	28	28	0,00	3,168 % éch. 25/01/2037 ^	12	10	0,00				
6,000 % éch. 25/10/2037 ^	1 124	678	0,01	3,320 % éch. 25/05/2037 ^	13	10	0,00	Total des valeurs mobilières		\$ 6 106 201	76,88
6,115 % éch. 25/06/2036	3	3	0,00	3,321 % éch. 25/04/2037 ^	9	8	0,00	ACTIONS			
Morgan Stanley Re-REMIC Trust				3,528 % éch. 25/12/2036 ^	8	7	0,00	FONDS D'INVESTISSEMENT			
2,643 % éch. 26/03/2037	73	69	0,00	3,597 % éch. 25/07/2037 ^	463	393	0,01	ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
2,702 % éch. 26/02/2037	100	92	0,00	3,672 % éch. 25/08/2036 ^	44	40	0,00	PIMCO Funds: Global Investors			
New Residential Mortgage Loan Trust				3,704 % éch. 25/02/2037 ^	29	24	0,00	Series plc - Fonds Asia			
3,500 % éch. 25/12/2057	1 598	1 499	0,02	3,712 % éch. 25/10/2036 ^	266	232	0,00	Strategic Interest Bond			
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				3,754 % éch. 25/09/2036 ^	24	21	0,00	Fund (e)	3 488 745	31 189	0,39
4,937 % éch. 25/08/2035	26	25	0,00	3,754 % éch. 25/09/2036 ^	85	71	0,00				
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				3,768 % éch. 25/12/2036 ^	23	21	0,00				
5,710 % éch. 25/12/2035	290	269	0,01	3,823 % éch. 27/02/2034	115	108	0,00				
7,175 % éch. 25/02/2035	181	184	0,00	3,875 % éch. 25/12/2035	66	61	0,00				
Prime Mortgage Trust				3,883 % éch. 25/03/2036	115	105	0,00				
6,000 % éch. 25/06/2036 ^	7	7	0,00	3,913 % éch. 25/04/2035	11	10	0,00				
				4,008 % éch. 25/12/2046	48	43	0,00				

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
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (e)	7 821 400	\$ 71 097	0,90	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	9 278 795	\$ 92 398	1,16	FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
						527 926	6,65	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	2 698 640	\$ 268 056	3,37
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (e)	33 191 429	333 242	4,20					Total des Fonds d'investissement*		\$ 795 982	10,02

* L'exposition du Fonds Diversified Income Fund aux Fonds d'investissement a légèrement dépassé 10 %. Le Fonds est revenu au niveau conforme 3 juillet 2023.

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	5,080 %	30/06/2023	07/07/2023	\$ 250 000	Billets du Trésor américain 0,250 % - 1,875 % échéance 31/07/2025 - 31/08/2027	\$ (255 041)	\$ 250 000	\$ 250 247	3,15
	5,160	30/06/2023	03/07/2023	1 600	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/07/2031	(1 640)	1 600	1 601	0,02
BRC	5,120	30/06/2023	03/07/2023	401 800	Billets du Trésor américain 3,875 % échéance 30/04/2025	(410 212)	401 800	401 971	5,07
	5,130	30/06/2023	03/07/2023	97 700	Ginnie Mae 2,500 % échéance 20/08/2051	(100 088)	97 700	97 742	1,23
	5,180	30/06/2023	03/07/2023	343 200	Obligations du Trésor américain 2,250 % - 4,250 % échéance 15/05/2039 - 15/08/2046	(353 153)	343 200	343 348	4,32
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	37 737	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	(38 492)	37 737	37 737	0,48
	5,060	30/06/2023	03/07/2023	67 700	Billets du Trésor américain 3,875 % échéance 31/12/2027	(69 054)	67 700	67 729	0,85
MBC	5,160	30/06/2023	03/07/2023	36 100	Billets du Trésor américain 4,125 % échéance 15/11/2032	(37 293)	36 100	36 116	0,45
TDM	5,160	30/06/2023	03/07/2023	800	Billets du Trésor américain 1,250 % échéance 31/03/2028	(821)	800	800	0,01
Total des contrats de mise en pension						\$ (1 265 794)	\$ 1 236 637	\$ 1 237 291	15,58

⁽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 septembre	Long	09/2023	156	\$ (67)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Long	09/2023	1 739	(2 734)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	8 584	7 405	0,09
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	3 590	(10 143)	(0,13)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	8 296	(16 784)	(0,22)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	7 062	(13 331)	(0,17)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Long	09/2023	802	(983)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	2 569	4 369	0,06
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (32 268)	(0,41)

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	\$ 75	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	12 800	(138)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	4 400	32	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2023	1 300	(7)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2026	500	6	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2027	1 200	6	0,00
CCO Holdings LLC	5,000	20/12/2027	21 000	63	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2023	3 700	(641)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/12/2024	600	8	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2025	1 300	38	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2026	800	35	0,00

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

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 %	20/06/2027	\$ 6 900	\$ 136	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	14 300	389	0,01
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	35 000	149	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	4 300	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20/06/2026	4 200	(339)	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20/12/2025	€ 35 900	(4 245)	(0,05)
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20/12/2027	26 000	(3 310)	(0,04)
Marks & Spencer PLC	1,000	20/12/2024	18 600	1 003	0,01
Marks & Spencer PLC	1,000	20/12/2028	11 000	185	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	40 600	(143)	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20/06/2028	\$ 1 400	6	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20/12/2026	€ 19 300	(272)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20/06/2027	8 300	282	0,00
				\$ (6 682)	(0,08)

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 à 5 ans	1,000 %	20/06/2028	\$ 55 500	\$ 1 361	0,02
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	69 102	349	0,00
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	5,000	20/06/2028	527 500	14 785	0,19
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	270 800	1 929	0,02
				\$ 18 424	0,23

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	\$ 3 581	0,04
À payer ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250	20/09/2053	5 100	(459)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	46 400	2 960	0,04
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	¥ 12 250 000	(196)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	0,880	03/03/2024	CAD 273 400	(9 072)	(0,11)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,500	19/06/2029	91 700	(8 700)	(0,11)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,520	07/07/2027	€ 127 500	(6 726)	(0,09)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	4 400	(54)	0,00
					\$ (18 666)	(0,24)

Total des Instruments financiers dérivés compensés

\$ (6 924) (0,09)

(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.

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 %	20/06/2028	\$ 22 000	\$ (1 915)	\$ 375	\$ (1 540)	(0,02)
BRC	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/06/2031	61 600	(2 646)	1 374	(1 272)	(0,02)
	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 1 200	113	(195)	(82)	0,00
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30/06/2029	\$ 5 000	0	155	155	0,00
FBF	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 4 400	415	(715)	(300)	0,00
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20/12/2026	7 400	(46)	(1 782)	(1 828)	(0,02)
	Intrum AB	5,000	20/12/2024	41 200	4 386	(7 197)	(2 811)	(0,03)
JPM	Hochtief AG	5,000	20/12/2026	16 400	3 874	(1 560)	2 314	0,03
	Intrum AB	5,000	20/12/2024	1 000	92	(160)	(68)	0,00
MYC	Intrum AB	5,000	20/12/2024	6 400	650	(1 087)	(437)	(0,01)
MYI	Intrum AB	5,000	20/12/2024	8 200	893	(1 452)	(559)	(0,01)
					\$ 5 816	\$ (12 244)	\$ (6 428)	(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	08/2023	AUD	1 954	\$ 1 322	\$ 20	\$ 0	\$ 20	0,00
	08/2023	\$	131	CNY 900	0	(7)	(7)	0,00
	08/2023		7 940	€ 7 334	82	(5)	77	0,00
	08/2023		1 443	£ 1 140	7	0	7	0,00
BPS	07/2023	€	1 991 475	\$ 2 140 851	0	(31 849)	(31 849)	(0,40)
	08/2023		5 358	€ 5 745	0	(113)	(113)	0,00
	08/2023	\$	155	CNY 1 058	0	(8)	(8)	0,00
	08/2023		61 924	€ 56 604	42	(83)	(41)	0,00
	08/2023		3 032	£ 2 381	0	(4)	(4)	0,00
	12/2023	MXN	10 668	\$ 598	0	(5)	(5)	0,00
BRC	08/2023	¥	31 340	€ 237	19	0	19	0,00
	08/2023	\$	32 808	€ 30 341	362	0	362	0,00
CBK	08/2023		24 085	£ 19 305	464	0	464	0,01
	07/2023		2 165 160	€ 1 991 475	7 541	0	7 541	0,10
	08/2023	AUD	199	\$ 131	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	CAD	458	343	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023	CNH	43	6	0	0	0	0,00
	08/2023	€	2 024 945	2 204 411	0	(7 855)	(7 855)	(0,10)
	08/2023	£	288 389	359 632	0	(7 100)	(7 100)	(0,09)
	08/2023	NOK	741	71	2	0	2	0,00
	08/2023	SEK	2 188	216	13	0	13	0,00
	08/2023	\$	12 313	€ 11 366	119	(6)	113	0,00
GLM	08/2023		1 037	£ 837	27	0	27	0,00
	08/2023	NOK	941	\$ 89	1	0	1	0,00
JPM	07/2023	\$	599	MXN 10 335	3	0	3	0,00
	08/2023	CAD	752	\$ 563	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	\$	163	CNY 1 116	0	(9)	(9)	0,00
	08/2023		15 106	€ 13 975	174	(2)	172	0,00
	08/2023		20 786	£ 16 411	84	0	84	0,00
	09/2023	INR	28 628	\$ 347	0	(1)	(1)	0,00
MBC	10/2023	MXN	66 385	3 781	0	(15)	(15)	0,00
	08/2023	CAD	2 323	1 746	0	(11)	(11)	0,00
	08/2023	\$	320 729	€ 290 653	0	(2 971)	(2 971)	(0,04)
MYI	07/2023	£	173	\$ 219	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	MXN	1 300	76	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	50	AUD 76	0	0	0	0,00
	07/2023		2 148	€ 1 972	3	0	3	0,00
	07/2023		5 954	£ 4 718	45	0	45	0,00
	08/2023	AUD	172	\$ 115	0	0	0	0,00
	08/2023	€	2 630	2 878	2	0	2	0,00
	08/2023	¥	448 787	3 377	252	0	252	0,00
	08/2023	\$	6 193	€ 5 704	43	0	43	0,00
	09/2023	INR	6 183	\$ 75	0	0	0	0,00
RBC	07/2023	\$	3 836	MXN 73 804	460	0	460	0,01
	08/2023	MXN	186	\$ 11	0	0	0	0,00
	08/2023	\$	4 080	£ 3 229	26	0	26	0,00
RYL	08/2023	€	26 474	\$ 28 686	0	(257)	(257)	0,00
	08/2023	\$	3 295	€ 3 051	40	0	40	0,00
SCX	08/2023	€	26 951	\$ 29 590	126	0	126	0,00
	08/2023	\$	434	CNY 2 963	0	(24)	(24)	0,00
	09/2023	INR	17 904	\$ 217	0	0	0	0,00
SOG	07/2023	\$	766	PLN 3 302	46	0	46	0,00
TOR	08/2023	¥	206 694	\$ 1 559	120	0	120	0,00
UAG	08/2023	CAD	2 411	1 784	0	(40)	(40)	0,00
	08/2023	\$	7 132	€ 6 577	58	0	58	0,00
	08/2023		18 170	£ 14 375	110	0	110	0,00
	09/2023	SGD	39	\$ 29	0	0	0	0,00
09/2023	\$	1 156	ZAR 20 273	0	(91)	(91)	0,00	
				\$ 10 291	\$ (50 468)	\$ (40 177)	(0,51)	

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	2 656	\$ 1 763	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	07/2023	\$	3 278	AUD 5 009	56	0	56	0,00
BOA	08/2023		1 764	2 656	5	0	5	0,00
	07/2023	AUD	10	\$ 7	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	\$	6 607	AUD 10 160	156	0	156	0,01
	07/2023	AUD	13 951	\$ 9 237	0	(49)	(49)	0,00
	07/2023	\$	5	AUD 7	0	0	0	0,00
	08/2023		9 014	13 598	45	0	45	0,00

Tableau des investissements Fonds Diversified 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
CBK	07/2023	AUD 82	\$ 56	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2023	\$ 2 120	AUD 3 250	43	0	43	0,00
JPM	07/2023	3 226	4 935	59	0	59	0,00
MBC	07/2023	AUD 21	\$ 14	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	4 686	3 111	0	(8)	(8)	0,00
	07/2023	\$ 2 580	AUD 3 948	48	0	48	0,00
	08/2023	3 113	4 686	8	0	8	0,00
SOG	07/2023	5 127	7 837	89	0	89	0,00
TOR	07/2023	AUD 8 181	\$ 5 404	0	(42)	(42)	0,00
	07/2023	\$ 5 447	AUD 8 329	97	0	97	0,00
	08/2023	5 408	8 181	42	0	42	0,00
UAG	07/2023	AUD 15 788	\$ 10 483	20	(46)	(26)	0,00
	07/2023	\$ 2 624	AUD 4 009	44	0	44	0,00
	08/2023	10 481	15 772	46	(20)	26	0,00
				\$ 759	\$ (170)	\$ 589	0,01

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 105 228	CAD 143 182	\$ 2 977	\$ 0	\$ 2 977	0,04
BPS	07/2023	CAD 2 101	\$ 1 589	1	0	1	0,00
CBK	07/2023	700	527	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$ 3 605	CAD 4 913	107	0	107	0,00
JPM	07/2023	105 613	143 280	2 665	0	2 665	0,03
MBC	07/2023	CAD 2 517	\$ 1 870	0	(32)	(32)	0,00
RBC	07/2023	\$ 3	CAD 4	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	106 146	144 161	2 799	0	2 799	0,04
TOR	07/2023	CAD 256 526	\$ 193 615	80	(326)	(246)	0,00
	08/2023	\$ 193 615	CAD 256 424	327	(79)	248	0,00
				\$ 8 956	\$ (439)	\$ 8 517	0,11

Au 30 juin 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	07/2023	CHF 9 120	\$ 10 197	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07/2023	\$ 13 850	CHF 12 530	155	0	155	0,00
	08/2023	10 197	9 094	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07/2023	CHF 39	\$ 43	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	114	127	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 7	CHF 6	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	CHF 277	\$ 307	0	(4)	(4)	0,00
RBC	07/2023	577	646	1	0	1	0,00
RYL	07/2023	4	5	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	\$ 10 007	CHF 8 992	43	0	43	0,00
UAG	07/2023	CHF 9 523	\$ 10 623	0	(21)	(21)	0,00
	07/2023	\$ 9 049	CHF 8 131	39	0	39	0,00
	08/2023	10 508	9 392	21	0	21	0,00
				\$ 262	\$ (28)	\$ 234	0,00

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 4 702	\$ 5 124	\$ 6	\$ (12)	\$ (6)	0,00
	07/2023	\$ 1 094 208	€ 1 018 148	16 593	0	16 593	0,21
BPS	07/2023	€ 1 020 099	\$ 1 117 700	4 777	(5)	4 772	0,06
	07/2023	\$ 1 092 384	€ 1 016 164	16 252	0	16 252	0,20
	08/2023	1 110 013	1 011 642	0	(4 801)	(4 801)	(0,06)
CBK	07/2023	€ 1 034 212	\$ 1 124 010	9	(4 326)	(4 317)	(0,05)
	08/2023	\$ 1 082 832	€ 994 579	3 740	0	3 740	0,05
JPM	07/2023	€ 1 011 775	\$ 1 104 758	910	0	910	0,01
	07/2023	\$ 45 124	€ 42 205	921	0	921	0,01
	08/2023	1 106 303	1 011 775	0	(945)	(945)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 22 691	\$ 24 437	16	(335)	(319)	0,00
SOG	07/2023	\$ 1 093 128	€ 1 016 164	15 509	0	15 509	0,19
				\$ 58 733	\$ (10 424)	\$ 48 309	0,61

Au 30 juin 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	07/2023	£ 304	\$ 384	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	07/2023	\$ 86	£ 67	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	£ 1 386	\$ 1 723	2	(42)	(40)	0,00
	07/2023	\$ 359 899	£ 290 972	10 028	0	10 028	0,13
BRC	07/2023	£ 345	\$ 434	1	(5)	(4)	0,00
	07/2023	\$ 1 045	£ 839	22	0	22	0,00
CBK	07/2023	£ 1 141	\$ 1 444	1	(8)	(7)	0,00
	07/2023	\$ 112	£ 88	1	0	1	0,00
JPM	07/2023	£ 292 056	\$ 369 275	0	(2 031)	(2 031)	(0,03)
	08/2023	\$ 369 354	£ 292 056	2 026	0	2 026	0,03
MBC	07/2023	£ 114	\$ 146	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 362 027	£ 292 451	9 780	0	9 780	0,12
MYI	07/2023	£ 118	\$ 147	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	\$ 358 803	£ 288 691	8 224	0	8 224	0,10
TOR	07/2023	£ 292 594	\$ 371 799	0	(190)	(190)	0,00
	08/2023	\$ 371 880	£ 292 594	184	0	184	0,00
				\$ 30 270	\$ (2 283)	\$ 27 987	0,35

Au 30 juin 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	07/2023	¥ 3 024	\$ 22	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2023	\$ 884	¥ 122 915	0	(34)	(34)	0,00
BPS	07/2023	884	122 915	0	(34)	(34)	0,00
SCX	07/2023	797	110 715	0	(31)	(31)	0,00
				\$ 1	\$ (99)	\$ (98)	0,00

Au 30 juin 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
BPS	07/2023	MXN 147 822	\$ 8 587	\$ 0	\$ (33)	\$ (33)	0,00
	07/2023	\$ 6 653	MXN 119 686	325	0	325	0,01
	08/2023	8 539	147 822	34	0	34	0,00
BRC	07/2023	MXN 147 434	\$ 8 581	0	(15)	(15)	0,00
	08/2023	\$ 8 533	MXN 147 434	17	0	17	0,00
CBK	07/2023	MXN 147 434	\$ 8 578	0	(18)	(18)	0,00
	07/2023	\$ 6 235	MXN 112 151	304	0	304	0,00
GLM	08/2023	8 994	155 434	20	0	20	0,00
	07/2023	3 127	56 273	154	0	154	0,00
MYI	07/2023	1 286	22 238	11	0	11	0,00
	08/2023	227	3 892	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07/2023	1 247	21 601	12	0	12	0,00
SCX	07/2023	6 165	110 741	292	0	292	0,00
				\$ 1 169	\$ (67)	\$ 1 102	0,01

Au 30 juin 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	07/2023	SEK 57 153	\$ 5 296	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	08/2023	\$ 5 212	SEK 56 179	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07/2023	3 570	38 996	40	0	40	0,00
MBC	07/2023	3 494	37 631	0	(10)	(10)	0,00
MYI	07/2023	SEK 56 273	\$ 5 212	2	0	2	0,00
	07/2023	\$ 5 026	SEK 53 949	0	(31)	(31)	0,00
SCX	08/2023	5 212	56 203	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	3 501	37 867	5	0	5	0,00
				\$ 51	\$ (48)	\$ 3	0,00

Au 30 juin 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions 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	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	07/2023	\$ 29 664	SGD 40 139	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
GLM	07/2023	SGD 942	\$ 701	6	0	6	0,00
	07/2023	\$ 542	SGD 729	0	(3)	(3)	0,00

Tableau des investissements Fonds Diversified 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	
JPM	07/2023	SGD	40 283	\$ 29 769	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07/2023	\$	3 907	SGD 5 287	0	0	0	0,00
	08/2023		29 769	40 245	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07/2023		27 101	36 616	0	(45)	(45)	0,00
	08/2023		60	81	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	SGD	39 938	\$ 29 556	46	(1)	45	0,00
	08/2023	\$	28 847	SGD 38 943	0	(43)	(43)	0,00
UAG	07/2023		29 482	39 880	0	(15)	(15)	0,00
					\$ 55	\$ (114)	\$ (59)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ 39 979	0,50	
Total des Investissements						\$ 8 139 607	102,48	
Autres actifs et passifs à court terme						\$ (196 890)	(2,48)	
Actifs nets						\$ 7 942 717	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) Titres à coupon zéro.

(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 : 0,18 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc. 2,572 % échéance 03/06/2031	26/05/2020	\$ 6 900	\$ 5 760	0,07
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	10/06/2022	92	92	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 15,000 % échéance 31/07/2023	06/12/2022	1 785	1 873	0,02
Deutsche Bank AG 3,035 % échéance 28/05/2032	25/05/2021 - 29/07/2021	1 122	867	0,01
Deutsche Bank AG 3,729 % échéance 14/01/2032	12/08/2022 - 16/08/2022	2 323	2 195	0,03
DrillCo Holding Lux S.A.	08/06/2023	8 869	8 513	0,11
General Motors Co. 6,800 % échéance 01/10/2027	07/05/2020	699	728	0,01
Intelsat Emergence S.A.	24/02/2020 - 29/10/2021	16 083	4 235	0,05
		\$ 37 873	\$ 24 263	0,30

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 62 998 \$ (31 décembre 2022 : 6 805 \$) et un montant en numéraire de 0 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 288 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 192 048 \$ (31 décembre 2022 : 268 487 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 17 052 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 6 070 952	\$ 35 249	\$ 6 106 201
Fonds d'investissement	795 982	0	0	795 982
Contrats de mise en pension	0	1 236 637	0	1 236 637
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	4 603	(3 971)	155	787
Totaux	\$ 800 585	\$ 7 303 618	\$ 35 404	\$ 8 139 607

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 30 juin 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	2,750 %	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (17 524)	\$ (19 189)	(0,24)
	3,050	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(666)	(729)	(0,01)
JML	2,500	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(17 980)	(19 681)	(0,25)
	2,500	06/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(2 528)	(2 762)	(0,03)
	2,500	08/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(2 124)	(2 321)	(0,03)
	2,500	12/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(1 273)	(1 390)	(0,02)
MYI	1,500	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(3 011)	(3 293)	(0,04)
	1,750	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(4 384)	(4 794)	(0,06)
	2,500	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(3 343)	(3 655)	(0,05)
	2,500	26/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(4 921)	(5 381)	(0,07)
Total des contrats de prise en pension					\$ (63 195)	(0,80)

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 56	\$ (40)	\$ 16	\$ 58	\$ 0	\$ 58
BOA	18 240	(14 110)	4 130	941	(920)	21
BPS	(5 365)	6 570	1 205	650	(800)	(150)
BRC	(494)	670	176	(2 633)	2 650	17
CBK	(7 352)	4 410	(2 942)	(1 931)	1 730	(201)
DUB	155	(180)	(25)	S/O	S/O	S/O
FBF	(300)	260	(40)	(104)	260	156
GLM	158	0	158	233	(250)	(17)
GST	(4 639)	4 592	(47)	(2 878)	2 952	74
JPM	6 080	(5 590)	490	2 534	(3 820)	(1 286)
MBC	6 393	(3 110)	3 283	27 060	(25 160)	1 900
MYC	(437)	270	(167)	(152)	260	108
MYI	7 982	(5 140)	2 842	(196)	260	64
RBC	499	(300)	199	(385)	430	45
RYL	(217)	280	63	S/O	S/O	S/O
SCX	3 258	(3 110)	148	561	(330)	231
SOG	15 644	(11 550)	4 094	S/O	S/O	S/O
TOR	213	(140)	73	(772)	660	(112)
UAG	105	0	105	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)		31 décembre 2022 (%)	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	53,21	48,23		
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	23,55	25,74		
Autres valeurs mobilières	0,12	1,67		
Fonds d'investissement	10,02	10,02		
Contrats de mise en pension	15,58	19,95		
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,41)	(0,32)		
Instruments financiers dérivés compensés	(0,09)	(0,15)		
Instruments financiers dérivés hors cote	0,50	0,27		
Contrats de prise en pension	(0,80)	(0,08)		

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Albanie	0,21	0,18
Argentine	0,64	0,52
Australie	0,08	0,07
Biélorussie	S/O	0,03
Bermudes	0,82	0,72
Brésil	0,00	0,00
Canada	0,45	0,29
Îles Caïmans	1,86	2,14
Chili	0,08	0,08
Chine	0,01	0,03
Colombie	0,47	0,42
Chypre	0,20	0,17
Danemark	0,16	0,14
République dominicaine	0,44	0,38
Équateur	0,21	0,25
Égypte	0,50	0,56
Finlande	0,05	0,08
France	2,25	3,16
Allemagne	2,22	3,24
Ghana	0,08	0,06
Guernesey, Îles Anglo-normandes	0,27	0,54
Hong Kong	0,27	0,98
Inde	S/O	0,02
Indonésie	0,91	0,60
Internationales	0,11	S/O
Irlande	6,48	6,34
Israël	S/O	0,11
Italie	3,87	3,95
Côte d'Ivoire	0,17	0,12
Japon	0,52	0,92
Jersey, Îles Anglo-normandes	1,03	1,02
Jordanie	0,05	S/O
Kazakhstan	0,07	S/O
Libéria	0,02	S/O
Luxembourg	3,21	3,92
Macédoine du nord	0,09	0,08
Île Maurice	S/O	0,08
Mexique	2,03	1,79
Multinationales	0,37	0,33
Pays-Bas	3,43	3,82
Nigeria	0,50	0,41
Oman	0,36	0,31
Panama	0,28	0,25
Pérou	0,24	S/O
Philippines	0,03	S/O
Portugal	0,16	0,14
Qatar	0,13	0,12
Roumanie	0,33	0,07
Russie	0,20	0,29
Arabie saoudite	0,79	S/O
Serbie	0,20	0,07
Singapour	0,17	0,15
Slovénie	0,19	0,16
Afrique du Sud	0,20	0,09
Espagne	0,97	0,97
Sri Lanka	0,13	0,08
Suède	0,40	0,37
Suisse	0,99	1,22
Turquie	0,77	0,70
Ukraine	0,29	0,22
Émirats arabes unis	0,14	0,13
Royaume-Uni	5,55	7,14
États-Unis	28,18	22,65
Venezuela	0,03	0,03
Îles Vierges britanniques	S/O	0,06
Instruments à court terme	2,02	2,87
Fonds d'investissement	10,02	10,02
Contrats de mise en pension	15,58	19,95
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,41)	(0,32)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,08)	(0,12)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,23	0,18
Swaps de taux d'intérêt	(0,24)	(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	(0,08)	(0,02)
Contrats de change à terme	(0,51)	(0,76)
Contrats de change à terme couverts	1,09	1,05
Autres actifs et passifs à court terme	(2,48)	(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				
OMAN				SUÈDE				DESCRIPTION							
ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Santander UK Group Holdings PLC							
Obligation internationale du gouvernement omanais				Volvo Car AB				3,823 % éch. 03/11/2028	\$ 1 500	\$ 1 352	0,26				
6,750 % éch. 17/01/2048	\$ 1 600	\$ 1 541	0,30	4,250 % éch. 31/05/2028	€ 2 000	\$ 2 100	0,40	6,750 % éch. 24/06/2024	£ 700	835	0,16				
								(g)(i)							
PÉROU				SUISSE				Virgin Media Secured Finance PLC							
ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,250 % éch. 15/01/2030			2 300	2 308	0,44		
Obligation internationale du gouvernement péruvien				Credit Suisse AG				Virgin Money UK PLC							
8,750 % éch. 21/11/2033	1 000	1 271	0,24	6,500 % éch. 08/08/2023 (i)	\$ 2 800	2 790	0,54	4,000 % éch. 03/09/2027			1 400	1 558	0,30		
								Total Royaume-Uni			18 268	3,50			
ROUMANIE				UBS Group AG				TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS							
ÉMISSIONS SOUVERAINES				4,282 % éch. 09/01/2028			700	647	0,12	PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX					
Obligation internationale du gouvernement roumain				Total Suisse			3 437	0,66	Towd Point Mortgage Funding PLC						
2,000 % éch. 14/04/2033	€ 600	464	0,09	TURQUIE					5,635 % éch. 20/10/2051			1 635	2 081	0,40	
2,875 % éch. 13/04/2042	600	403	0,08	ÉMISSIONS SOUVERAINES					Total Royaume-Uni			20 349	3,90		
5,000 % éch. 27/09/2026	2 000	2 192	0,42	Obligation internationale du gouvernement turc											
Total Roumanie		3 059	0,59	4,875 % éch. 16/04/2043	1 200	773	0,15								
				5,750 % éch. 11/05/2047	4 900	3 361	0,64								
RUSSIE				Total Turquie			4 134	0,79	ÉTATS-UNIS						
ÉMISSIONS SOUVERAINES				UKRAINE					TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS						
Obligation internationale du gouvernement russe				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					Aames Mortgage Investment Trust						
4,250 % éch. 23/06/2027 ^	\$ 600	261	0,05	NPC Ukrenargo					5,930 % éch. 25/10/2035			\$ 104	102	0,02	
5,250 % éch. 23/06/2047 ^	200	89	0,02	6,875 % éch. 09/11/2028 ^			800	172	0,03	6,350 % éch. 25/06/2035			11	10	0,00
5,250 % éch. 23/06/2047 ^	1 400	84	0,01	ÉMISSIONS SOUVERAINES					Accredited Mortgage Loan Trust						
Total Russie		434	0,08	Obligation internationale du gouvernement ukrainien					5,870 % éch. 25/09/2035			101	99	0,02	
				4,375 % éch. 27/01/2032 ^	€ 4 400	1 049	0,20	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust							
ARABIE SAOUDITE				6,750 % éch. 20/06/2028 ^	200	47	0,01	5,520 % éch. 25/02/2037			2 455	1 065	0,20		
ÉMISSIONS SOUVERAINES				8,994 % éch. 01/02/2026 ^	\$ 300	76	0,02	5,750 % éch. 25/02/2036			67	66	0,01		
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite				Total Ukraine			1 344	0,26	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates						
3,450 % éch. 02/02/2061	1 400	987	0,19						5,855 % éch. 25/11/2035			61	60	0,01	
4,500 % éch. 26/10/2046	1 200	1 054	0,20						8,525 % éch. 25/11/2032 ^			479	468	0,09	
4,875 % éch. 18/07/2033	2 500	2 501	0,48						Argent Securities Trust						
Total Arabie saoudite		4 542	0,87						5,470 % éch. 25/05/2036			567	141	0,03	
									Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust						
SERBIE				EMIRATS ARABES UNIS					4,705 % éch. 25/12/2035			9	9	0,00	
ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					6,155 % éch. 25/06/2035			504	483	0,09	
Obligation internationale du gouvernement serbe				DAE Sukuk Dific Ltd.					6,950 % éch. 25/07/2034			21	21	0,00	
6,500 % éch. 26/09/2033	1 000	983	0,19	3,750 % éch. 15/02/2026			900	856	0,16	Carrington Mortgage Loan Trust					
				ROYAUME-UNI					5,410 % éch. 25/02/2037			716	648	0,12	
SLOVÉNIE				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					6,200 % éch. 25/05/2035			280	268	0,05	
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				AGPS BondCo PLC					Countrywide Asset-Backed Certificates						
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.	€ 1 000	1 055	0,20	4,625 % éch. 14/01/2026 ^			€ 100	43	0,01	6,250 % éch. 25/05/2047 ^			796	604	0,12
1,875 % éch. 27/01/2025				5,000 % éch. 27/04/2027 ^			500	194	0,04	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
Nova Ljubljanska Banka d.d.	600	557	0,11	5,500 % éch. 13/11/2026 ^			500	209	0,04	3,221 % éch. 25/03/2036			68	66	0,01
3,400 % éch. 05/02/2030				Barclays PLC					5,330 % éch. 25/11/2047 ^			537	508	0,10	
Total Slovénie		1 612	0,31	5,875 % éch. 15/09/2024			£ 200	228	0,04	5,630 % éch. 25/02/2037 ^			1 600	1 426	0,27
				(g)(i)					5,675 % éch. 25/08/2036			2 100	2 001	0,38	
AFRIQUE DU SUD				7,750 % éch. 15/09/2023			\$ 600	589	0,11	5,990 % éch. 25/10/2047			1 854	1 762	0,34
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				(g)(i)					6,200 % éch. 25/11/2034			63	62	0,01	
AngloGold Ashanti Holdings PLC	\$ 200	172	0,03	Bellis Acquisition Co. PLC					6,725 % éch. 25/11/2034			133	130	0,03	
3,750 % éch. 01/10/2030				3,250 % éch. 16/02/2026			£ 2 100	2 241	0,43	Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.					
				Greene King Finance PLC					5,710 % éch. 25/04/2034			176	157	0,03	
ÉMISSIONS SOUVERAINES				5,106 % éch. 15/03/2034			267	299	0,06	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.					
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				HSBC Holdings PLC					4,599 % éch. 25/01/2032			3	3	0,00	
5,650 % éch. 27/09/2047	1 200	852	0,17	2,804 % éch. 24/05/2032			\$ 300	243	0,05	Ellington Loan Acquisition Trust					
Total Afrique du Sud		1 024	0,20	2,848 % éch. 04/06/2031			200	166	0,03	6,200 % éch. 25/05/2037			323	304	0,06
				3,973 % éch. 22/05/2030			600	539	0,10	First Franklin Mortgage Loan Trust					
ESPAGNE				4,041 % éch. 13/03/2028			300	281	0,06	6,425 % éch. 25/07/2034			136	133	0,03
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,210 % éch. 11/08/2028			1 600	1 566	0,30	Fremont Home Loan Trust					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				John Lewis PLC					5,690 % éch. 25/04/2036			282	251	0,05	
6,000 % éch. 15/01/2026	€ 800	821	0,16	4,250 % éch. 18/12/2034			£ 400	317	0,06	6,080 % éch. 25/06/2035 ^			700	620	0,12
(g)(i)				6,125 % éch. 21/01/2025			300	367	0,07	GSAA Home Equity Trust					
6,138 % éch. 14/09/2028	\$ 600	602	0,11	Lloyds Banking Group PLC					5,270 % éch. 25/11/2036			75	19	0,00	
Banco de Sabadell S.A.	€ 1 700	1 846	0,35	4,976 % éch. 11/08/2033			\$ 400	374	0,07	GSAMP Trust					
5,375 % éch. 08/09/2026				Market Bidco Finco PLC					5,200 % éch. 25/12/2046			24	12	0,00	
Lorca Telecom Bondco S.A.	300	299	0,06	4,750 % éch. 04/11/2027			€ 1 500	1 322	0,25	5,240 % éch. 25/01/2037			42	24	0,00
4,000 % éch. 18/09/2027				Mitchells & Butlers Finance PLC					5,630 % éch. 25/06/2036			196	104	0,02	
Total Espagne		3 568	0,68	6,002 % éch. 15/12/2030			\$ 777	715	0,14	5,630 % éch. 25/08/2036			568	450	0,09
				6,469 % éch. 15/09/2032			£ 332	368	0,07	5,885 % éch. 25/09/2035 ^			79	76	0,01
SRI LANKA				NatWest Group PLC					Home Equity Asset Trust						
ÉMISSIONS SOUVERAINES				6,000 % éch. 29/12/2025			\$ 1 700	1 577	0,30	6,245 % éch. 25/05/2035			63	62	0,01
Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka				(g)(i)					Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust						
7,550 % éch. 28/03/2030 ^	\$ 1 000	461	0,09	Pinnacle Bidco PLC					5,530 % éch. 25/06/2036			20	20	0,00	
7,850 % éch. 14/03/2029 ^	600	276	0,05	5,500 % éch. 15/02/2025			€ 100	105	0,02	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust					
Total Sri Lanka		737	0,14	6,375 % éch. 15/02/2025			£ 200	243	0,05	3,815 % éch. 25/07/2036			158	155	0,03
									5,340 % éch. 25/03/2047			88	86	0,02	
									5,410 % éch. 25/06/2037			49	49	0,01	
									5,450 % éch. 25/07/2036			647	290	0,06	
									5,450 % éch. 25/03/2037			400	359	0,07	

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	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Long Beach Mortgage Loan Trust				Aviation Capital Group LLC				Newell Brands, Inc.			
5,690 % éch. 25/05/2046	\$ 554	\$ 177	0,03	3,500 % éch. 01/11/2027	\$ 600	\$ 530	0,10	6,000 % éch. 01/04/2046	\$ 400	\$ 317	0,06
5,750 % éch. 25/02/2036	894	736	0,14	5,500 % éch. 15/12/2024	800	783	0,15	NGPL PipeCo LLC			
MASTR Asset-Backed Securities Trust				BAT Capital Corp.				7,768 % éch. 15/12/2037	1 400	1 497	0,29
5,350 % éch. 25/08/2036	3 719	1 180	0,23	3,557 % éch. 15/08/2027	100	92	0,02	Noble Finance LLC			
5,450 % éch. 25/03/2036	1 035	923	0,18	Boeing Co.				8,000 % éch. 15/04/2030	450	458	0,09
5,900 % éch. 25/12/2034 ^	12	11	0,00	3,950 % éch. 01/08/2059	500	370	0,07	NuStar Logistics LP			
5,930 % éch. 25/02/2034	453	436	0,08	5,705 % éch. 01/05/2040	500	499	0,10	5,625 % éch. 28/04/2027	1 400	1 347	0,26
6,050 % éch. 25/04/2034	92	87	0,02	British Airways Pass-Through Trust				Occidental Petroleum Corp.			
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				4,250 % éch. 15/05/2034	104	95	0,02	6,625 % éch. 01/09/2030	700	728	0,14
5,290 % éch. 25/05/2037	195	140	0,03	Broadcom, Inc.				7,875 % éch. 15/09/2031	1 700	1 898	0,36
5,470 % éch. 25/09/2036	235	105	0,02	3,137 % éch. 15/11/2035	508	390	0,08	Organon & Co.			
5,730 % éch. 25/01/2035	560	555	0,11	3,187 % éch. 15/11/2036	1 015	768	0,15	2,875 % éch. 30/04/2028	€ 3 500	3 324	0,63
5,855 % éch. 25/01/2035	290	273	0,05	Charter Communications Operating LLC				Pacific Gas & Electric Co.			
7,050 % éch. 25/02/2047	121	101	0,02	3,850 % éch. 01/04/2061	1 200	727	0,14	3,150 % éch. 01/01/2026	\$ 400	371	0,07
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust				CommScope, Inc.				3,300 % éch. 15/03/2027 ^	100	91	0,02
6,725 % éch. 25/11/2032	6	5	0,00	4,750 % éch. 01/09/2029	2 200	1 737	0,33	3,300 % éch. 01/06/2040	1 800	1 215	0,23
New Century Home Equity Loan Trust				Community Health Systems, Inc.				3,450 % éch. 01/07/2025	200	189	0,04
8,150 % éch. 25/01/2033 ^	186	159	0,03	8,000 % éch. 15/03/2026	300	292	0,06	3,500 % éch. 01/06/2025 ^	100	95	0,02
NovaStar Mortgage Funding Trust				Crown Castle, Inc.				3,750 % éch. 01/07/2028	200	179	0,03
5,310 % éch. 25/09/2037	214	211	0,04	2,100 % éch. 01/04/2031	700	561	0,11	4,450 % éch. 15/04/2042 ^	100	76	0,01
Option One Mortgage Loan Trust				2,250 % éch. 15/01/2031	800	653	0,13	4,500 % éch. 01/07/2040	850	662	0,13
5,370 % éch. 25/01/2037	256	147	0,03	5,000 % éch. 11/01/2028	700	688	0,13	4,550 % éch. 01/07/2030	200	181	0,03
5,885 % éch. 25/08/2035	26	26	0,01	DAE Funding LLC				4,600 % éch. 15/06/2043 ^	200	152	0,03
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				3,375 % éch. 20/03/2028	600	541	0,10	4,650 % éch. 01/08/2028	300	278	0,05
6,200 % éch. 25/09/2034	21	20	0,00	DISH DBS Corp.				Piper Sandler Cos.			
6,950 % éch. 25/12/2034	473	466	0,09	5,750 % éch. 01/12/2028	800	597	0,11	5,200 % éch. 15/10/2023	600	598	0,12
Renaissance Home Equity Loan Trust				DISH Network Corp.				Plains All American Pipeline LP			
5,340 % éch. 25/01/2037	1 336	470	0,09	11,750 % éch. 01/09/2029	675	659	0,13	5,150 % éch. 01/06/2042	1 500	1 247	0,24
Residential Asset Securities Corp. Trust				Elevance Health, Inc.				6,650 % éch. 15/01/2037	200	201	0,04
5,609 % éch. 25/01/2034	30	29	0,01	4,750 % éch. 15/02/2033	600	583	0,11	PRA Group, Inc.			
5,840 % éch. 25/11/2035	78	77	0,01	Energy Transfer LP				8,375 % éch. 01/02/2028	700	635	0,12
5,855 % éch. 25/09/2035	651	609	0,12	7,500 % éch. 01/07/2038	2 000	2 195	0,42	RLJ Lodging Trust LP			
Saxon Asset Securities Trust				EnLink Midstream LLC				3,750 % éch. 01/07/2026	200	184	0,04
5,615 % éch. 25/03/2036	303	289	0,06	5,375 % éch. 01/06/2029	300	286	0,06	Rockies Express Pipeline LLC			
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				EQT Corp.				4,800 % éch. 15/05/2030	700	612	0,12
5,330 % éch. 25/07/2036	87	31	0,01	3,625 % éch. 15/05/2031	400	345	0,07	4,950 % éch. 15/07/2029	300	275	0,05
5,825 % éch. 25/01/2035	19	18	0,00	Ford Motor Credit Co. LLC				Sirius XM Radio, Inc.			
Soundview Home Loan Trust				1,744 % éch. 19/07/2024	€ 300	317	0,06	4,125 % éch. 01/07/2030	800	654	0,13
5,615 % éch. 25/06/2036 ^	4 818	3 958	0,76	2,330 % éch. 25/11/2025	2 400	2 461	0,47	Southern California Edison Co.			
Structured Asset Investment Loan Trust				2,386 % éch. 17/02/2026	300	308	0,06	4,000 % éch. 01/04/2047	200	159	0,03
5,530 % éch. 25/03/2036	87	84	0,02	2,700 % éch. 10/08/2026	€ 700	626	0,12	Spirit AeroSystems, Inc.			
5,780 % éch. 25/11/2035	287	275	0,05	3,021 % éch. 06/03/2024	€ 1 100	1 186	0,23	9,375 % éch. 30/11/2023	100	107	0,02
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				3,375 % éch. 13/11/2025	€ 300	279	0,05	Sprint Capital Corp.			
6,150 % éch. 25/08/2037	114	112	0,02	4,174 % éch. 01/12/2024	€ 1 700	1 832	0,35	6,875 % éch. 15/11/2028	1 385	1 469	0,28
Structured Asset Securities Corp. Trust				Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				Standard Industries, Inc.			
5,840 % éch. 25/09/2035	222	210	0,04	5,500 % éch. 01/05/2028	\$ 1 400	1 283	0,25	2,250 % éch. 21/11/2026	€ 1 800	1 749	0,34
Truman Capital Mortgage Loan Trust				6,500 % éch. 01/10/2025	1 237	1 220	0,23	T-Mobile USA, Inc.			
5,410 % éch. 25/03/2036	374	369	0,07	Freedom Mortgage Corp.				2,550 % éch. 15/02/2031	\$ 400	333	0,06
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				6,625 % éch. 15/01/2027	1 100	953	0,18	4,950 % éch. 15/03/2028	500	492	0,09
5,300 % éch. 25/01/2037	171	141	0,03	Global Atlantic Fin Co.				Tallgrass Energy Partners LP			
		25 603	4,91	4,400 % éch. 15/10/2029	1 000	844	0,16	5,500 % éch. 15/01/2028	500	458	0,09
				GLP Capital LP				6,000 % éch. 31/12/2030	300	265	0,05
				5,750 % éch. 01/06/2028	300	294	0,06	Time Warner Cable LLC			
				Haleon U.S. Capital LLC				5,875 % éch. 15/11/2040	500	441	0,08
				3,375 % éch. 24/03/2029	600	546	0,11	U.S. Airways Pass-Through Trust			
				HCA, Inc.				3,950 % éch. 15/05/2027	164	153	0,03
				5,500 % éch. 01/06/2033	1 000	999	0,19	United Airlines Pass-Through Trust			
				IQVIA, Inc.				2,900 % éch. 01/11/2029	85	74	0,01
				5,700 % éch. 15/05/2028	600	595	0,11	3,450 % éch. 01/06/2029	132	121	0,02
				Kinder Morgan Energy Partners LP				3,450 % éch. 07/01/2030	142	123	0,02
				6,500 % éch. 01/02/2037	400	413	0,08	3,500 % éch. 01/09/2031	157	142	0,03
				6,950 % éch. 15/01/2038	200	215	0,04	4,150 % éch. 11/10/2025	254	250	0,05
				Las Vegas Sands Corp.				5,875 % éch. 15/04/2029	2 372	2 354	0,45
				3,200 % éch. 08/08/2024	500	485	0,09	Venture Global Calcasieu Pass LLC			
				3,500 % éch. 18/08/2026	600	559	0,11	6,250 % éch. 15/01/2030	1 000	993	0,19
				3,900 % éch. 08/08/2029	300	268	0,05	Venture Global LNG, Inc.			
				Medline Borrower LP				8,125 % éch. 01/06/2028	2 200	2 237	0,43
				3,875 % éch. 01/04/2029	500	435	0,08	Verizon Communications, Inc.			
				5,250 % éch. 01/10/2029	500	434	0,08	2,355 % éch. 15/03/2032	2 200	1 770	0,34
				Midwest Connector Capital Co. LLC				VICI Properties LP			
				3,900 % éch. 01/04/2024	100	98	0,02	3,500 % éch. 15/02/2025	200	191	0,04
				National Fuel Gas Co.				WGM Acquisition Corp.			
				5,200 % éch. 15/07/2025	200	196	0,04	3,000 % éch. 15/02/2031	1 100	891	0,17
				Netflix, Inc.				XPO, Inc.			
				4,875 % éch. 15/06/2030	1 400	1 379	0,26	6,250 % éch. 01/06/2028	500	493	0,09

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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	
Zayo Group Holdings, Inc. 4,000 % éch. 01/03/2027	\$ 300	\$ 212	0,04	5,697 % éch. 20/10/2045 5,777 % éch. 19/11/2035	\$ 291	\$ 259	0,05	INSTRUMENTS À COURT TERME				
		68 106	13,05	HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,590 % éch. 25/11/2035	1 396	1 306	0,25	BILLETTS À COURT TERME				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				IndyMac Mortgage Loan Trust 3,103 % éch. 25/06/2037 ^	10	9	0,00	Corestate Capital Holding S.A. 15,000 % éch. 31/07/2023 (j)	€ 200	\$ 220	0,04	
Adient U.S. LLC 8,334 % éch. 10/04/2028	1	1	0,00	3,677 % éch. 25/12/2036 ^	2	2	0,00	BONS DU TRÉSOR ARGENTIN				
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 7,396 % éch. 01/12/2027	2 145	2 145	0,41	5,510 % éch. 25/07/2047	54	37	0,01	(28,578) % éch. 18/10/2023 (e)(f) ARS	843	2	0,00	
CenturyLink, Inc. 7,467 % éch. 15/03/2027	3 729	2 888	0,56	Lehman Mortgage Trust 6,000 % éch. 25/09/2037 ^	102	94	0,02	(12,549) % éch. 23/11/2023 (e)(f)	823	2	0,00	
Charter Communications Operating LLC 6,795 % - 6,834 % éch. 01/02/2027	5 188	5 163	0,99	Luminent Mortgage Trust 5,550 % éch. 25/10/2046	675	603	0,12			4	0,00	
CommScope, Inc. 8,443 % éch. 06/04/2026	481	462	0,09	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 4,459 % éch. 25/05/2036 5,810 % éch. 25/11/2029	3 1	3 1	0,00 0,00	BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Level 3 Financing, Inc. 6,967 % éch. 01/03/2027	1 626	1 519	0,29	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 4,148 % éch. 25/03/2036 ^	31	20	0,00	5,238 % éch. 17/08/2023 (b)(e)(f)(l)	\$ 8 500	8 445	1,62	
Standard Industries, Inc. 7,692 % éch. 22/09/2028	1 313	1 314	0,25	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust 4,937 % éch. 25/08/2035	1	1	0,00	Total des Instruments à court terme		8 669	1,66	
		13 492	2,59	Residential Accredit Loans, Inc. Trust 5,550 % éch. 25/05/2047	59	53	0,01	Total des valeurs mobilières	\$ 359 563		68,93	
TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHECAIRES NON EMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 5,590 % éch. 25/06/2037	197	174	0,03	ACTIONS				
Banc of America Alternative Loan Trust 5,550 % éch. 25/01/2037 ^	84	65	0,01	Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,570 % éch. 25/09/2047 ^	446 569	358 471	0,07 0,09	FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
Banc of America Funding Trust 4,416 % éch. 20/01/2047 ^	42	39	0,01	SunTrust Alternative Loan Trust 5,750 % éch. 25/12/2035 ^	2	2	0,00	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (h)				
BCAP LLC Trust 6,250 % éch. 26/08/2036	1 928	897	0,17	Thornburg Mortgage Securities Trust 6,400 % éch. 25/06/2037 ^	11	10	0,00	250 000				
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 6,800 % éch. 25/02/2036	6	6	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 5,176 % éch. 25/11/2042	5	5	0,00	2 235				
Citigroup Mortgage Loan Trust 3,620 % éch. 25/10/2046 ^	20	18	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,022 % éch. 25/09/2036 ^	126	37	0,01	0,43				
Countrywide Alternative Loan Trust 5,456 % éch. 25/01/2036	10	10	0,00			6 584	1,26	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (h)				
5,550 % éch. 25/07/2036 ^	3	1	0,00	AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				538 168				
5,577 % éch. 20/05/2046 ^	279	237	0,05	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/12/2052			954	950	6 095			
5,550 % éch. 25/04/2036	555	209	0,04	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % éch. 01/08/2053			10 100	9 899	1,17			
6,000 % éch. 25/02/2036 ^	137	75	0,01	5,500 % éch. 01/08/2053			9 400	9 354	6,98			
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	852	379	0,07	6,000 % éch. 01/08/2053			4 200	4 236	0,04			
6,000 % éch. 25/04/2037 ^	198	115	0,02	6,500 % éch. 01/07/2053			6 200	6 331	9,75			
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 4,085 % éch. 25/03/2037 ^	8	7	0,00	Total États-Unis			144 573	27,71	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (h)			
4,936 % éch. 25/04/2046 ^	17	5	0,00	VENEZUELA OBLIGATIONS ET BILLETTS PRIVÉS					3 624 810			
5,690 % éch. 25/04/2046	1 715	499	0,10	Pétroleos de Venezuela S.A. 6,000 % éch. 16/05/2024 ^			1 600	62	36 393			
6,000 % éch. 25/12/2036 ^	334	145	0,03	ÉMISSIONS SOUVERAINES					6,98			
6,000 % éch. 25/07/2037	66	25	0,01	Obligation internationale du gouvernement vénézuélien 6,000 % éch. 09/12/2020 ^			241	15	0,00			
6,500 % éch. 25/11/2036 ^	107	41	0,01	7,000 % éch. 31/03/2038 ^			1 528	134	0,03			
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 6,500 % éch. 25/04/2033	0	0	0,00	7,750 % éch. 13/10/2019 ^			1 900	114	0,02			
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 3,387 % éch. 26/04/2038	75	72	0,01	Total Venezuela				325	0,06			
3,616 % éch. 27/09/2035	98	83	0,02									
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 4,267 % éch. 25/09/2035	12	11	0,00									
HarborView Mortgage Loan Trust 5,597 % éch. 19/05/2035	149	136	0,03									
5,637 % éch. 19/06/2035	3	3	0,00									

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	5,170 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 91 100	Obligations du Trésor américain 3,250 % échéance 15/05/2042	\$ (93 785)	\$ 91 100	\$ 91 139	17,47
BPS	5,100	30/06/2023	03/07/2023	100	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/01/2030	(102)	100	100	0,02
	5,160	30/06/2023	03/07/2023	7 100	Billets du Trésor américain 2,000 % échéance 15/08/2025	(7 251)	7 100	7 103	1,36
	5,170	30/06/2023	03/07/2023	5 800	Ginnie Mae 2,500 % échéance 20/10/2051	(6 004)	5 800	5 802	1,11
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	3 266	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	(3 331)	3 266	3 266	0,63
Total des contrats de mise en pension						\$ (110 473)	\$ 107 366	\$ 107 410	20,59

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged 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 septembre	Long	09/2023	24	\$ (33)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	344	(983)	(0,19)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	242	(482)	(0,09)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	556	(1 095)	(0,21)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	117	32	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	201	329	0,06
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Long	09/2023	23	(24)	0,00
				\$ (2 256)	(0,43)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (2 256)	(0,43)

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	\$ (19)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	300	2	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2026	500	2	0,00
CCO Holdings LLC	5,000	20/12/2027	1 000	4	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	1 000	26	0,01
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20/12/2025	€ 3 300	(390)	(0,08)
Marks & Spencer PLC	1,000	20/12/2024	4 100	222	0,04
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	4 000	(13)	0,00
				\$ (166)	(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.HY-39 à 5 ans	5,000 %	20/12/2027	\$ 4 455	\$ 162	0,03
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	5,000	20/06/2028	33 600	942	0,18
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	26 400	198	0,04
				\$ 1 302	0,25

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

À payer	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		3,750 %	20/09/2028	£ 13 300	\$ 851	0,16
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour		0,050	15/12/2031	¥ 940 000	(32)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour		0,000	16/09/2023	\$ 22 300	(318)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour		0,000	17/09/2023	33 800	(463)	(0,09)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour		1,000	15/06/2027	67 100	70	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour		1,000	16/12/2030	22 300	4 150	0,80
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour		1,250	17/06/2025	33 800	3 959	0,76
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour		1,750	15/06/2032	20 600	(151)	(0,03)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour		1,750	15/06/2052	14 000	(16)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour		2,750	21/06/2053	30 200	1 787	0,34
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour		3,000	21/06/2033	56 400	2 531	0,49
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour		3,250	21/06/2028	82 400	2 675	0,51
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour		3,500	21/06/2026	27 700	(429)	(0,08)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour		3,750	21/06/2025	55 700	1 219	0,23
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois		0,000	16/09/2023	22 300	320	0,06
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois		0,000	17/09/2023	33 800	465	0,09
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois		2,500	20/09/2053	€ 2 000	(27)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois		3,000	20/09/2028	34 500	(115)	(0,02)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois		3,000	20/09/2033	2 100	(23)	0,00
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois		3,500	20/09/2025	26 800	(9)	0,00
						\$ 16 444	3,15
Total des Instruments financiers dérivés compensés						\$ 17 580	3,37

⁽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.

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 %	20/06/2028	\$ 2 000	\$ (174)	\$ 34	\$ (140)	(0,03)
BRC	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/06/2031	5 500	(236)	122	(114)	(0,02)
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20/12/2026	€ 700	(5)	(168)	(173)	(0,03)
JPM	Hochtief AG	5,000	20/12/2026	2 700	643	(262)	381	0,07
					\$ 228	\$ (274)	\$ (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	08/2023	\$ 5 057	€ 4 647	\$ 23	\$ 0	\$ 23	0,01
BPS	07/2023	123 254	112 489	0	(529)	(529)	(0,10)
	08/2023	€ 113 365	\$ 124 367	532	(17)	515	0,10
	08/2023	\$ 9 906	€ 9 061	12	(12)	0	0,00
BRC	08/2023	3 528	3 258	34	0	34	0,01
	08/2023	714	£ 563	2	0	2	0,00
CBK	08/2023	€ 3 047	\$ 3 297	0	(34)	(34)	(0,01)
	08/2023	£ 15 761	19 655	0	(388)	(388)	(0,07)
	08/2023	\$ 1 929	€ 1 776	13	(1)	12	0,00
GLM	07/2023	BRL 2 961	\$ 550	0	(64)	(64)	(0,01)
	07/2023	\$ 615	BRL 2 970	1	0	1	0,00
	09/2023	BRL 3 003	\$ 615	0	(1)	(1)	0,00
JPM	08/2023	£ 399	496	0	(12)	(12)	0,00
	08/2023	\$ 1 433	£ 1 131	6	0	6	0,00
MBC	08/2023	10 058	€ 9 115	0	(93)	(93)	(0,02)
MYI	07/2023	149	137	0	0	0	0,00
	07/2023	1 407	£ 1 115	11	0	11	0,00
	08/2023	¥ 33 066	\$ 249	18	0	18	0,01
	08/2023	\$ 456	€ 421	4	0	4	0,00
RBC	08/2023	276	£ 219	2	0	2	0,00
	08/2023	98	MXN 1 707	0	0	0	0,00
RYL	08/2023	€ 2 879	\$ 3 120	0	(28)	(28)	(0,01)
SCX	08/2023	2 917	3 203	14	0	14	0,00
	08/2023	\$ 564	£ 455	15	0	15	0,00
SOG	07/2023	€ 112 489	\$ 121 009	0	(1 717)	(1 717)	(0,33)
SSB	09/2023	\$ 322	BRL 1 634	13	0	13	0,00
TOR	08/2023	¥ 15 229	\$ 115	9	0	9	0,00
UAG	08/2023	\$ 1 343	€ 1 238	11	0	11	0,00
	08/2023	1 252	£ 991	8	0	8	0,00
				\$ 728	\$ (2 896)	\$ (2 168)	(0,42)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 123	\$ 134	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 52 328	€ 48 691	793	0	793	0,15
BPS	07/2023	€ 48 084	\$ 52 685	225	0	225	0,04
	07/2023	\$ 52 299	€ 48 649	777	0	777	0,15
	08/2023	52 470	47 820	0	(227)	(227)	(0,04)
CBK	07/2023	€ 49 186	\$ 53 491	8	(179)	(171)	(0,03)
	07/2023	\$ 94	€ 87	2	0	2	0,00
	08/2023	50 210	46 117	173	0	173	0,03
JPM	07/2023	€ 47 687	\$ 52 069	43	0	43	0,01
	08/2023	\$ 52 142	€ 47 687	0	(44)	(44)	(0,01)

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged 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	07/2023	€ 1 079	\$ 1 165	\$ 1	\$ (13)	\$ (12)	0,00
	07/2023	\$ 31	€ 29	1	0	1	0,00
SOG	07/2023	\$ 52 268	\$ 48 588	742	0	742	0,14
				\$ 2 765	\$ (463)	\$ 2 302	0,44

Au 30 juin 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
BPS	07/2023	\$ 91 940	£ 74 332	\$ 2 563	\$ 0	\$ 2 563	0,49
BRC	07/2023	£ 149	\$ 189	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 2	£ 1	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	£ 146	\$ 183	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$ 10	£ 8	0	0	0	0,00
JPM	07/2023	£ 75 705	\$ 95 722	0	(527)	(527)	(0,10)
	08/2023	\$ 95 742	£ 75 705	525	0	525	0,10
MBC	07/2023	£ 45	\$ 58	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 93 623	£ 75 625	2 523	0	2 523	0,49
MYI	07/2023	£ 93 094	\$ 74 903	2 134	0	2 134	0,41
TOR	07/2023	£ 75 975	\$ 96 541	0	(49)	(49)	(0,01)
	08/2023	\$ 96 562	£ 75 975	48	0	48	0,01
				\$ 7 793	\$ (579)	\$ 7 214	1,39
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ 7 302	1,40
Total des Investissements						\$ 540 942	103,71
Autres actifs et passifs à court terme						\$ (19 375)	(3,71)
Actifs nets						\$ 521 567	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) 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 : 0,17 %) :

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. 15,000 % échéance 31/07/2023	06/12/2022	210	220	0,04
DrillCo Holding Lux S.A.	08/06/2023	1 233	1 185	0,23
Intelsat Emergence S.A.	24/02/2020 - 01/05/2020	1 289	331	0,06
		\$ 2 750	\$ 1 754	0,33

(k) Un titre d'une juste valeur globale de 365 \$ (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 30 juin 2023.

(l) Un titre d'une juste valeur globale de 391 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 740 \$ (31 décembre 2022 : 1 278 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 27 426 \$ (31 décembre 2022 : 19 045 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 356 569	\$ 2 989	\$ 359 563
Fonds d'investissement	51 387	0	0	51 387
Contrats de mise en pension	0	107 366	0	107 366
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(57)	22 683	0	22 626
Totaux	\$ 51 335	\$ 486 618	\$ 2 989	\$ 540 942

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 30 juin 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	2,500 %	06/06/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (337)	\$ (368)	(0,07)
Total des contrats de prise en pension					\$ (368)	(0,07)

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	676	(470)	206	(31)	0	(31)
BPS	3 324	(2 750)	574	104	0	104
BRC	(78)	0	(78)	(270)	208	(62)
CBK	(409)	391	(18)	1 636	(1 510)	126
GLM	(64)	20	(44)	(204)	270	66
GST	(173)	0	(173)	(179)	0	(179)
JPM	372	(410)	(38)	27	(80)	(53)
MBC	2 419	(1 790)	629	(1 015)	800	(215)
MYI	2 167	(1 550)	617	4	(28)	(24)
RBC	2	0	2	S/O	S/O	S/O
RYL	(28)	0	(28)	S/O	S/O	S/O
SCX	29	0	29	1 547	(1 450)	97
SOG	(975)	720	(255)	S/O	S/O	S/O
SSB	13	0	13	S/O	S/O	S/O
TOR	8	(10)	(2)	65	(120)	(55)
UAG	19	0	19	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	43,25	38,87
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	25,45	30,57
Autres valeurs mobilières	0,23	1,69
Fonds d'investissement	9,85	9,88
Contrats de mise en pension	20,59	18,21
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,43)	0,25
Instruments financiers dérivés compensés	3,37	1,95
Instruments financiers dérivés hors cote	1,40	0,30
Contrats de prise en pension	(0,07)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Argentine	0,65	0,45
Biélorussie	S/O	0,05
Bermudes	0,70	0,54
Brésil	0,00	0,00
Canada	0,59	0,42
Îles Caïmans	2,09	2,11
Chili	S/O	0,09
Chine	0,06	0,08
Colombie	0,44	0,40
Chypre	0,20	0,17
Danemark	0,17	0,15
République dominicaine	0,43	0,38
Équateur	0,20	0,24
Égypte	0,51	0,59
Finlande	0,15	0,09
France	2,22	3,32
Allemagne	1,57	3,45
Ghana	0,07	0,06
Guernesey, Îles Anglo-normandes	0,17	0,43
Hong Kong	0,31	1,08
Inde	S/O	0,05
Indonésie	0,69	0,45
Irlande	2,67	2,38
Italie	3,35	4,15
Côte d'Ivoire	0,54	S/O
Japon	0,59	1,11
Jersey, Îles Anglo-normandes	1,26	1,16
Kazakhstan	0,07	S/O
Luxembourg	3,77	5,22
Macédoine du nord	0,06	0,05
Île Maurice	S/O	0,13
Mexique	2,31	1,67
Multinationales	0,47	0,42
Pays-Bas	2,89	3,96
Nigeria	0,53	0,44
Oman	0,30	0,27
Pérou	0,24	S/O
Qatar	S/O	0,22
Roumanie	0,59	0,14
Russie	0,08	0,14
Arabie saoudite	0,87	S/O
Serbie	0,19	S/O
Slovénie	0,31	0,27
Afrique du Sud	0,20	0,07
Espagne	0,68	0,62
Sri Lanka	0,14	0,09
Suède	0,40	0,35
Suisse	0,66	0,58
Turquie	0,79	0,85
Ukraine	0,26	0,20
Émirats arabes unis	0,16	0,15
Royaume-Uni	3,90	4,30
États-Unis	27,71	22,26
Îles Vierges britanniques	S/O	0,08
Venezuela	0,06	0,07
Instruments à court terme	1,66	5,18
Fonds d'investissement	9,85	9,88
Contrats de mise en pension	20,59	18,21
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,43)	0,25
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,03)	(0,12)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,25	0,23
Swaps de taux d'intérêt	3,15	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	(0,01)	(0,01)
Contrats de change à terme	(0,42)	(0,46)
Contrats de change à terme couverts	1,83	0,77
Autres actifs et passifs à court terme	(3,71)	(1,72)
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				ÉQUATEUR				INDONÉSIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Obligation internationale du gouvernement argentin				Obligation internationale du gouvernement d'Équateur				Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
3,500 % éch. 09/07/2041	\$	900	0,50	2,500 % éch. 31/07/2035	\$	400	0,24	4,700 % éch. 06/06/2032	\$	500	0,86
AUSTRALIE				ÉGYPTE				IRLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
FMG Resources Pty. Ltd.				Obligation internationale du gouvernement égyptien				Bank of Ireland Group PLC			
4,375 % éch. 01/04/2031		200	0,30	6,375 % éch. 11/04/2031	€	400	0,42	6,253 % éch. 16/09/2026		200	0,34
BERMUDES				FINLANDE				GE Capital UK Funding Unlimited Co.			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,875 % éch. 18/01/2033			
NCL Corp. Ltd.				Nokia Oyj				Perrigo Finance Unlimited Co.			
8,375 % éch. 01/02/2028		200	0,36	3,125 % éch. 15/05/2028		100	0,18	4,650 % éch. 15/06/2030	\$	200	0,30
BRÉSIL				FRANCE				ITALIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco BTG Pactual S.A.				Accor S.A.				Intesa Sanpaolo SpA			
2,750 % éch. 11/01/2026		100	0,16	2,375 % éch. 29/11/2028		100	0,17	8,248 % éch. 21/11/2033		50	0,09
ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Mundys SpA			
Obligation internationale du gouvernement brésilien				Altice France S.A.				1,875 % éch. 12/02/2028			
5,000 % éch. 27/01/2045		200	0,27	5,125 % éch. 15/07/2029	\$	300	0,36	Nexti SpA			
Total Brésil				AXA S.A.				2,125 % éch. 30/04/2029			
			0,43	5,500 % éch. 11/07/2043	€	100	0,19	Telecom Italia SpA			
CANADA				CHROME BIDCO SASU				1,625 % éch. 18/01/2029			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,500 % éch. 31/05/2028				100			
Air Canada Pass-Through Trust				Crown European Holdings S.A.				84			
5,250 % éch. 01/10/2030		411	0,69	2,875 % éch. 01/02/2026		100	0,18	2,125 % éch. 30/04/2029		100	0,16
B. C. Unlimited Liability Co.				Forvia				Telecom Italia SpA			
4,000 % éch. 15/10/2030		350	0,52	2,375 % éch. 15/06/2029		200	0,31	1,625 % éch. 18/01/2029		100	0,14
ÎLES CAÏMANS				JCDecaux SE				414			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,000 % éch. 11/01/2029				0,71			
Avolon Holdings Funding Ltd.				Loxam S.A.S.				CÔTE D'IVOIRE			
2,528 % éch. 18/11/2027		100	0,14	4,500 % éch. 15/02/2027		100	0,18	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Seagate HDD Cayman				Société Générale S.A.				Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire			
3,125 % éch. 15/07/2029		50	0,07	6,691 % éch. 10/01/2034	\$	200	0,35	6,125 % éch. 15/06/2033	\$	100	0,15
5,750 % éch. 01/12/2034		200	0,31	Vilmorin & Cie S.A.			0,15	JAPON			
			0,52	1,375 % éch. 26/03/2028	€	100	0,15	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
CHILI				ALLEMAGNE				Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,475 % éch. 22/02/2031			
Obligation internationale du gouvernement chilien				Deutsche Bank AG				Mizuho Financial Group, Inc.			
3,100 % éch. 07/05/2041		300	0,39	1,625 % éch. 20/01/2027		100	0,17	3,490 % éch. 05/09/2027	€	300	0,55
COLOMBIE				1,875 % éch. 23/02/2028				Norinchukin Bank			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				3,742 % éch. 07/01/2033				5,430 % éch. 09/03/2028			
Obligation internationale du gouvernement colombien				Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.			
5,000 % éch. 15/06/2045		300	0,36	1,875 % éch. 31/03/2028	€	50	0,08	2,472 % éch. 14/01/2029		100	0,15
7,500 % éch. 02/02/2034		300	0,51	Schaeffler AG				Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
			0,87	3,375 % éch. 12/10/2028				5,500 % éch. 09/03/2028			
COSTA RICA				ZF Finance GmbH				1 007			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				2,000 % éch. 06/05/2027				1,74			
Obligation internationale du gouvernement costaricain				HONG KONG				KAZAKHSTAN			
5,625 % éch. 30/04/2043		250	0,37	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
DANEMARK				Lenovo Group Ltd.				Obligation internationale du gouvernement kazakh			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				6,536 % éch. 27/07/2032				6,500 % éch. 21/07/2045			
TDC Net A/S				6,691 % éch. 10/01/2034				200			
5,618 % éch. 06/02/2030	€	300	0,55	HONGRIE				212			
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				ÉMISSIONS SOUVERAINES				LIBÉRIA			
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine				Obligation internationale du gouvernement hongrois				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
4,500 % éch. 30/01/2030	\$	300	0,45	2,125 % éch. 22/09/2031		200	0,27	Royal Caribbean Cruises Ltd.			
6,500 % éch. 15/02/2048		400	0,60	6,750 % éch. 25/09/2052		200	0,35	4,250 % éch. 01/07/2026			
			1,05	INDE				LUXEMBOURG			
610				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
1,05				ReNew Power Pvt Ltd.				Altice Financing S.A.			
				5,875 % éch. 05/03/2027		275	0,44	5,750 % éch. 15/08/2029		200	0,27
584				0,10				Logicor Financing SARL			
584				1,01				1,625 % éch. 17/01/2030			
584				1,01				317			
584				1,01				0,55			
584				1,01				MEXIQUE			
584				1,01				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
584				1,01				Obligation internationale du gouvernement mexicain			
584				1,01				4,875 % éch. 19/05/2033			
584				1,01				5,750 % éch. 12/10/2110			
584				1,01				635			
584				1,01				1,09			

Tableau des investissements Fonds Diversified Income 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	
MAROC				PEROU				DESCRIPTON				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				ÉMISSIONS SOUVERAINES				Lloyds Banking Group PLC				
Obligation internationale du gouvernement marocain				Obligation internationale du gouvernement péruvien				7,500 % éch. 27/06/2024 (a)(c) \$ 50 \$ 48 0,08				
3,000 % éch. 15/12/2032	\$ 200	\$ 159	0,27	3,000 % éch. 15/01/2034	\$ 200	\$ 167	0,29	Marks & Spencer PLC	£ 100	113	0,20	
				3,300 % éch. 11/03/2041	400	309	0,53	National Grid PLC	€ 300	325	0,56	
						476	0,82	3,875 % éch. 16/01/2029				
MULTINATIONALES				PHILIPPINES				NatWest Group PLC				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				ÉMISSIONS SOUVERAINES				0,780 % éch. 26/02/2030				
Allied Universal Holdco LLC	€ 100	88	0,15	Obligation internationale du gouvernement philippin				Standard Chartered PLC				
3,625 % éch. 01/06/2028				5,500 % éch. 17/01/2048	250	257	0,44	0,800 % éch. 17/11/2029	200	178	0,31	
American Airlines, Inc.	\$ 50	49	0,09	POLOGNE				6,301 % éch. 09/01/2029 \$ 50 50 0,09				
5,750 % éch. 20/04/2029	300	291	0,50	ÉMISSIONS SOUVERAINES				Virgin Media Secured Finance PLC				
Ardagh Packaging Finance PLC	€ 200	195	0,34	Obligation internationale du gouvernement polonais				4,125 % éch. 15/08/2030				
2,125 % éch. 15/08/2026				4,875 % éch. 04/10/2033	125	123	0,21	€ 100 99 0,17				
NXP BV	\$ 50	50	0,09	ROUMANIE				Vmed O2 UK Financing PLC				
5,350 % éch. 01/03/2026				ÉMISSIONS SOUVERAINES				4,500 % éch. 15/07/2031				
		673	1,17	Obligation internationale du gouvernement roumain				200 194 0,33				
				1,750 % éch. 13/07/2030	€ 100	84	0,14	Vodafone Group PLC	\$ 300	218	0,38	
				6,625 % éch. 27/09/2029	75	85	0,15	5,125 % éch. 04/06/2081				
				7,625 % éch. 17/01/2053	\$ 200	220	0,38	Weir Group PLC	200	179	0,31	
						389	0,67	2,200 % éch. 13/05/2026				
										2 485	4,29	
PAYS-BAS				SERBIE				ÉTATS-UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				ÉMISSIONS SOUVERAINES				TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				
AerCap Holdings NV	200	189	0,32	Obligation internationale du gouvernement serbe				GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust				
5,875 % éch. 10/10/2079				1,650 % éch. 03/03/2033	€ 200	146	0,25	5,520 % éch. 22/02/2055	97	92	0,16	
Citycon Treasury BV	€ 100	80	0,14	SINGAPOUR				Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
1,625 % éch. 12/03/2028				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,450 % éch. 25/08/2036				
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 300	261	0,45	Flex Ltd.				45 44 0,08				
3,758 % éch. 06/04/2033				4,875 % éch. 15/06/2029	\$ 50	48	0,08			136	0,24	
CTP NV	€ 100	79	0,13	AFRIQUE DU SUD				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
1,250 % éch. 21/06/2029				ÉMISSIONS SOUVERAINES				AES Corp.				
Digital Dutch Finco BV	200	154	0,26	Obligation internationale du gouvernement sud-africain				2,450 % éch. 15/01/2031				
1,000 % éch. 15/01/2032				4,850 % éch. 30/09/2029	60	53	0,09	5,450 % éch. 01/06/2028	150	147	0,25	
Enel Finance International NV	\$ 50	39	0,07	5,650 % éch. 27/09/2047	60	42	0,07	Albertsons Cos., Inc.	100	87	0,15	
2,250 % éch. 12/07/2031	€ 300	317	0,55	5,750 % éch. 30/09/2049	300	213	0,37	3,500 % éch. 15/03/2029				
2,875 % éch. 11/04/2029						308	0,53	Ally Financial, Inc.	140	145	0,25	
ING Groep NV	€ 100	103	0,18	ESPAGNE				AMC Networks, Inc.				
4,125 % éch. 24/08/2033				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,250 % éch. 15/02/2029				
JDE Peet's NV	\$ 50	39	0,07	Abertis Infraestructuras S.A.				American Tower Corp.				
2,250 % éch. 24/09/2031				3,375 % éch. 27/11/2026	€ 100	113	0,19	2,900 % éch. 15/01/2030	50	43	0,07	
NE Property BV	€ 100	98	0,17	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	\$ 200	201	0,35	2,950 % éch. 15/01/2051	200	126	0,22	
3,375 % éch. 14/07/2027				6,138 % éch. 14/09/2026				Amgen, Inc.	100	54	0,09	
Prosus NV	\$ 200	157	0,27	Banco de Sabadell S.A.	€ 100	92	0,16	AT&T, Inc.	4,300 % éch. 15/02/2030	300	285	0,49
3,061 % éch. 13/07/2031				0,875 % éch. 16/06/2028				Avantor Funding, Inc.	3,875 % éch. 01/11/2029	200	175	0,30
Sensata Technologies BV	300	267	0,46	CaixaBank S.A.	100	108	0,19	Aviation Capital Group LLC	5,500 % éch. 15/12/2024	50	49	0,08
4,000 % éch. 15/04/2029				3,750 % éch. 07/09/2029				Axalta Coating Systems LLC	3,375 % éch. 15/02/2029	200	170	0,29
Universal Music Group NV	€ 100	109	0,19	Cellnex Finance Co. S.A.	400	344	0,59	Ball Corp.	2,875 % éch. 15/08/2030	400	332	0,57
4,000 % éch. 13/06/2031				2,000 % éch. 15/09/2032				Bank of America Corp.	6,204 % éch. 10/11/2028	600	617	1,06
Wabtec Transportation Netherlands BV	50	47	0,08	Grifols S.A.	300	297	0,51	Bank of New York Mellon Corp.	4,706 % éch. 01/02/2034	200	192	0,33
1,250 % éch. 03/12/2027		1 939	3,34	2,250 % éch. 15/11/2027		1 155	1,99	Beacon Roofing Supply, Inc.	4,500 % éch. 15/11/2026	200	190	0,33
				SUÈDE				Black Knight InfoServ LLC				
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,625 % éch. 01/09/2028				
				EQT AB				Boise Cascade Co.				
				0,875 % éch. 14/05/2031				4,875 % éch. 01/07/2030				
				ROYAUME-UNI				Builders FirstSource, Inc.				
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,250 % éch. 01/02/2032				
				Atlantica Sustainable Infrastructure PLC				Cable One, Inc.				
				4,125 % éch. 15/06/2028	\$ 250	223	0,38	4,000 % éch. 15/11/2030	100	78	0,14	
				Barclays PLC	200	216	0,37	Catalent Pharma Solutions, Inc.	3,125 % éch. 15/02/2029	200	163	0,28
				Berkeley Group PLC	£ 100	83	0,14					
				2,500 % éch. 11/08/2031								
				HSBC Holdings PLC	\$ 100	90	0,16					
				3,973 % éch. 22/05/2030								
				Land Securities Capital Markets PLC	£ 100	121	0,21					
				4,875 % éch. 15/09/2034								

Tableau des investissements Fonds Diversified Income ESG 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
MBC	5,160 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 7 400	Billets du Trésor américain 0,500 % échéance 28/02/2026	\$ (7 643)	\$ 7 400	\$ 7 403	12,76
Total des Contrats de mise en pension						\$ (7 643)	\$ 7 400	\$ 7 403	12,76

⁽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 septembre	Long	09/2023	1	\$ (2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	7	12	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Long	09/2023	6	(8)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	2	2	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	15	(46)	(0,08)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	5	(10)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	15	18	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	7	13	0,03
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	1	1	0,00
				\$ (20)	(0,03)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (20)	(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 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	\$ 100	\$ 0	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	3,250 %	20/09/2053	£ 30	\$ (3)	(0,01)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	100	(9)	(0,01)
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	150	10	0,02
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	150	5	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	¥ 10 000	0	0,00
					\$ 3	0,01
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 3	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.

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)	\$ 7	\$ (10)	(0,02)
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2028	200	(16)	2	(14)	(0,02)
BRC	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/06/2028	300	0	2	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2027	100	(17)	3	(14)	(0,02)
GST	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/06/2028	100	0	1	1	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
MYC	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000 %	20/12/2027	\$ 150	\$ (8)	\$ 5	\$ (3)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2028	200	(36)	6	(30)	(0,05)
					\$ (94)	\$ 26	\$ (68)	(0,12)

⁽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	07/2023	€ 18 284	\$ 19 650	\$ 0	\$ (298)	\$ (298)	(0,51)
	08/2023	261	281	0	(4)	(4)	(0,01)
BRC	08/2023	14 342	15 424	0	(255)	(255)	(0,44)
	08/2023	£ 297	373	0	(5)	(5)	(0,01)
	08/2023	\$ 149	€ 136	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	18 992	17 468	66	0	66	0,11
	08/2023	€ 17 468	\$ 19 018	0	(66)	(66)	(0,11)
MBC	08/2023	CAD 4	3	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 20 005	€ 18 129	0	(185)	(185)	(0,32)
MYI	07/2023	43	39	0	0	0	0,00
	08/2023	€ 14 342	\$ 15 424	0	(255)	(255)	(0,44)
	08/2023	£ 568	708	0	(14)	(14)	(0,02)
SCX	08/2023	\$ 3 579	€ 3 271	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023	105	£ 85	3	0	3	0,00
UAG	08/2023	£ 203	\$ 256	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$ 20 923	€ 19 058	0	(88)	(88)	(0,15)
				\$ 69	\$ (1 174)	\$ (1 105)	(1,90)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 179	\$ 194	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$ 15 822	€ 14 722	240	0	240	0,41
BRC	07/2023	€ 111	\$ 121	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 2	€ 2	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	€ 15 272	\$ 16 596	0	(64)	(64)	(0,11)
	08/2023	\$ 15 970	€ 14 668	55	0	55	0,09
GLM	07/2023	310	290	7	0	7	0,01
MBC	07/2023	€ 95	\$ 102	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 15 906	€ 14 880	328	0	328	0,57
SCX	07/2023	15 922	14 878	310	0	310	0,53
UAG	07/2023	€ 77	\$ 84	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 940	\$ (68)	\$ 872	1,50

Au 30 juin 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
MBC	07/2023	\$ 79	£ 64	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,01
MYI	07/2023	79	64	2	0	2	0,00
UAG	07/2023	81	65	2	0	2	0,00
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,01

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (295) (0,51)

Total des Investissements

\$ 56 439 97,33

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 1 550 2,67

Actifs nets

\$ 57 989 100,00

Tableau des investissements Fonds Diversified Income 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) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(b) Affilié au Fonds.

(c) Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 222 \$ (31 décembre 2022 : 113 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 473 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 44 261	\$ 26	\$ 44 287
Fonds d'investissement	5 064	0	0	5 064
Contrats de mise en pension	0	7 400	0	7 400
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	5	(317)	0	(312)
Totaux	\$ 5 069	\$ 51 344	\$ 26	\$ 56 439

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ (87)	\$ 0	\$ (87)	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BRC	(273)	243	(30)	S/O	S/O	S/O
CBK	(9)	0	(9)	S/O	S/O	S/O
GLM	7	(10)	(3)	2	0	2
GST	1	0	1	S/O	S/O	S/O
MBC	144	0	144	S/O	S/O	S/O
MYC	(33)	0	(33)	S/O	S/O	S/O
MYI	(267)	0	(267)	S/O	S/O	S/O
SCX	310	0	310	(57)	0	(57)
UAG	(88)	230	142	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	51,93	61,68
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	24,44	39,58
Fonds d'investissement	8,73	S/O
Contrats de mise en pension	12,76	S/O
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,03)	0,31
Instruments financiers dérivés compensés	0,01	0,10
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,51)	(0,54)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Argentine	0,50	0,58
Australie	0,30	S/O

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Bermudes	0,36	S/O
Bésil	0,43	3,50
Canada	1,21	0,72
Îles Caïmans	0,52	1,75
Chili	0,39	1,46
Colombie	0,87	1,39
Costa Rica	0,37	S/O
Danemark	0,55	1,07
République dominicaine	1,05	1,68
Équateur	0,24	0,47
Égypte	0,42	S/O
Finlande	0,36	1,03
France	2,40	6,29
Allemagne	1,01	3,73
Guernesey, Îles Anglo-normandes	S/O	0,95
Hong Kong	0,35	S/O
Hongrie	0,62	S/O
Inde	0,44	1,95
Indonésie	0,86	S/O
Irlande	0,75	1,24
Italie	0,71	0,88
Côte d'Ivoire	0,15	0,77
Japon	1,74	1,71
Kazakhstan	0,37	S/O
Libéria	0,56	S/O
Jersey, Îles Anglo-normandes	S/O	0,91
Luxembourg	0,55	1,95
Mexique	1,09	0,86
Maroc	0,27	1,40
Multi-pays	S/O	1,01
Multinationales	1,17	0,49
Pays-Bas	3,34	2,45
Oman	0,51	1,91
Panama	1,45	1,06
Paraguay	0,44	S/O
Pérou	0,82	0,74
Philippines	0,44	S/O
Pologne	0,21	S/O
Roumanie	0,67	0,76
Serbie	0,25	S/O
Singapour	0,08	0,96
Afrique du Sud	0,53	S/O
Espagne	1,99	3,85
Suède	0,40	0,75
Royaume-Uni	4,29	7,18
États-Unis	39,65	27,59
Uruguay	0,69	S/O
Instruments à court terme	S/O	16,22
Fonds d'investissement	8,73	S/O
Contrats de mise en pension	12,76	S/O
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,03)	0,31
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	S/O
Swaps de taux d'intérêt	0,01	0,10
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,12)	S/O
Contrats de change à terme	(1,90)	(0,61)
Contrats de change à terme couverts	1,51	0,07
Autres actifs et passifs à court terme	2,67	(1,13)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund

DESCRIPTION VALEURS MOBILIÈRES	VALEUR NOMINALE (en 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
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS											
American Airlines, Inc. 10,000 % éch. 20/04/2028	\$ 900	\$ 921	0,03	Balder Finland Oyj 1,000 % éch. 18/01/2027	€ 1 800	1 481	0,04	Deutsche Bank AG 0,898 % éch. 28/05/2024 (j)	\$ 1 900	1 806	0,05
BCP Modular Services Holdings Ltd. 8,023 % éch. 15/12/2028	€ 4 900	5 032	0,15	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % éch. 02/03/2026	6 500	7 108	0,21	1,375 % éch. 17/02/2032	€ 4 600	3 724	0,11
Carnival Corp. 8,217 % éch. 30/06/2025	\$ 2 619	2 618	0,08	Banco Santander S.A. 4,375 % éch. 14/01/2026 (g)(i)	3 200	2 934	0,09	2,625 % éch. 20/01/2027	€ 1 900	1 843	0,05
Charter Communications Operating LLC 6,795 % - 6,834 % éch. 01/02/2027	187	186	0,01	5,147 % éch. 18/08/2025	\$ 4 400	4 324	0,13	3,035 % éch. 16/12/2024	€ 1 200	1 420	0,04
Delos Finance SARL 7,288 % éch. 06/10/2023	3 220	3 222	0,10	Bank of America Corp. 2,687 % éch. 22/04/2032	200	166	0,00	3,742 % éch. 07/01/2033 (j)	\$ 1 200	881	0,03
Hertz Corp. 8,443 % éch. 30/06/2028	2 800	2 799	0,08	4,300 % éch. 28/01/2025 (g)	3 600	3 222	0,10	6,119 % éch. 14/07/2026	\$ 8 902	8 806	0,26
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % éch. 22/06/2026	4 774	4 775	0,14	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % éch. 19/05/2025 (g)(i)	€ 3 700	3 967	0,12	Digital Dutch Finco BV 1,500 % éch. 15/03/2030	€ 1 100	944	0,03
Intelsat Jackson Holdings S.A. 9,443 % éch. 01/02/2029	347	346	0,01	Barclays PLC 2,645 % éch. 24/06/2031	\$ 900	723	0,02	DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % éch. 25/01/2027	€ 3 500	2 901	0,09
IRB Holding Corp. 8,202 % éch. 15/12/2027	1 808	1 798	0,05	3,330 % éch. 24/11/2042	€ 3 600	2 531	0,07	EQT AB 2,375 % éch. 06/04/2028	1 200	1 155	0,03
MPH Acquisition Holdings LLC 9,726 % éch. 01/09/2028	4 421	3 963	0,12	3,375 % éch. 02/04/2025	€ 1 100	1 186	0,03	Equinix, Inc. 0,250 % éch. 15/03/2027	€ 1 500	1 427	0,04
Nouryon Finance BV 6,478 % éch. 03/04/2028	€ 5 476	5 878	0,17	4,337 % éch. 10/01/2028	\$ 300	283	0,01	3,900 % éch. 15/04/2032	\$ 300	270	0,01
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % éch. 16/11/2025	\$ 4 479	4 160	0,12	4,972 % éch. 16/05/2029	300	284	0,01	Erste Group Bank AG 6,500 % éch. 15/04/2024 (g)(i)	€ 200	212	0,01
United Airlines, Inc. 9,292 % éch. 21/04/2028	1 170	1 171	0,04	5,304 % éch. 09/08/2026	2 500	2 440	0,07	Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % éch. 29/04/2030	\$ 2 500	2 345	0,07
		36 869	1,10	5,501 % éch. 09/08/2028	€ 600	586	0,02	Ford Motor Credit Co. LLC 2,330 % éch. 25/11/2025	€ 200	205	0,01
				6,375 % éch. 15/12/2025 (g)(i)	€ 1 700	1 871	0,06	2,700 % éch. 10/08/2026	\$ 3 900	3 486	0,10
				7,385 % éch. 02/11/2028	\$ 2 500	2 606	0,08	2,748 % éch. 14/06/2024	€ 2 300	2 799	0,08
				7,437 % éch. 02/11/2033	2 700	2 923	0,09	2,900 % éch. 16/02/2028	\$ 1 800	1 543	0,05
				7,750 % éch. 15/09/2023 (g)(i)	800	786	0,02	3,021 % éch. 06/03/2024	€ 900	971	0,03
				8,000 % éch. 15/06/2024 (g)(i)	400	379	0,01	3,250 % éch. 15/09/2025	€ 100	105	0,00
				Bevco Lux SARL 1,000 % éch. 16/01/2030	€ 4 400	3 745	0,11	4,535 % éch. 06/03/2025	€ 200	242	0,01
				BGC Partners, Inc. 4,375 % éch. 15/12/2025	\$ 1 100	1 016	0,03	G City Europe Ltd. 4,250 % éch. 11/09/2025	€ 1 200	1 145	0,03
				Blue Owl Finance LLC 3,125 % éch. 10/06/2031	4 500	3 429	0,10	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % éch. 29/07/2026	1 300	1 069	0,03
				BNP Paribas S.A. 1,904 % éch. 30/09/2028	7 800	6 652	0,20	3,000 % éch. 29/03/2025	€ 3 100	2 799	0,08
				ABN AMRO Bank NV 4,375 % éch. 22/09/2025 (g)(i)	€ 700	690	0,02	Goldman Sachs Group, Inc. 1,000 % éch. 16/12/2025	€ 2 500	2 933	0,09
				Acef Holding S.C.A. 1,250 % éch. 26/04/2030	2 000	1 672	0,05	1,875 % éch. 16/12/2030	\$ 2 500	2 360	0,07
				Adler Financing SARL 12,500 % éch. 30/06/2025	2 989	3 347	0,10	2,615 % éch. 22/04/2032	\$ 200	164	0,00
				AerCap Ireland Capital DAC 2,450 % éch. 29/10/2026	\$ 500	447	0,01	3,615 % éch. 15/03/2028	€ 2 000	1 878	0,06
				3,000 % éch. 29/10/2028	200	173	0,01	3,691 % éch. 05/06/2028	300	282	0,01
				3,850 % éch. 21/07/2027	1 350	1 238	0,04	3,750 % éch. 22/05/2025	400	386	0,01
				4,450 % éch. 01/10/2025	2 850	2 743	0,08	6,491 % éch. 15/05/2026	800	810	0,02
				4,450 % éch. 03/04/2026	2 300	2 198	0,07	HSBC Holdings PLC 1,750 % éch. 24/07/2027	€ 3 200	3 469	0,10
				AGFC Capital Trust 7,010 % éch. 15/01/2067	2 500	1 348	0,04	2,357 % éch. 18/08/2031	\$ 2 200	1 757	0,05
				AGPS BondCo PLC 5,000 % éch. 27/04/2027 ^	€ 4 300	1 664	0,05	2,804 % éch. 24/05/2032	€ 800	647	0,02
				Aircastle Ltd. 2,850 % éch. 26/01/2028	\$ 1 500	1 277	0,04	2,871 % éch. 22/11/2032	5 000	4 035	0,12
				Altearea S.C.A. 1,750 % éch. 16/01/2030	€ 1 800	1 373	0,04	3,973 % éch. 22/05/2030	4 700	4 225	0,13
				1,875 % éch. 17/01/2028	1 700	1 500	0,04	4,583 % éch. 19/06/2029	4 170	3 928	0,12
				AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % éch. 17/07/2023	699	762	0,02	4,750 % éch. 04/07/2029 (g)(i)	€ 2 200	2 032	0,06
				2,250 % éch. 17/07/2027	2 600	2 577	0,08	5,210 % éch. 11/08/2028	\$ 2 600	2 544	0,08
				American Tower Corp. 0,400 % éch. 15/02/2026	3 100	2 935	0,09	6,254 % éch. 09/03/2034	3 800	3 897	0,12
				2,300 % éch. 15/09/2031	\$ 300	239	0,01	6,375 % éch. 30/03/2025 (g)(i)	500	480	0,01
				Annington Funding PLC 2,308 % éch. 06/10/2032	€ 1 000	885	0,03	Huarong Finance Co. Ltd. 3,375 % éch. 24/02/2030	900	683	0,02
				Antares Holdings LP 3,950 % éch. 15/07/2026	\$ 1 600	1 406	0,04	3,625 % éch. 30/09/2030	€ 2 600	1 975	0,06
				Aroundtown S.A. 0,375 % éch. 15/04/2027	€ 1 100	864	0,03	3,875 % éch. 13/11/2029	2 300	1 776	0,05
				5,375 % éch. 21/03/2029	\$ 16 200	12 004	0,36	4,250 % éch. 07/11/2027	500	417	0,01
				Atrium Finance PLC 2,625 % éch. 05/09/2027	€ 5 200	4 136	0,12	4,500 % éch. 29/05/2029	1 700	1 364	0,04
				Aviation Capital Group LLC 3,500 % éch. 01/11/2027	\$ 3 600	3 183	0,09	4,750 % éch. 27/04/2027	1 300	1 126	0,03
				5,500 % éch. 15/12/2024	200	196	0,01	4,950 % éch. 07/11/2047	1 200	800	0,02
				Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % éch. 18/11/2027	\$ 4 290	\$ 3 622	0,11	Hyundai Capital Services, Inc. 0,750 % éch. 15/09/2023	€ 3 500	3 463	0,10
								ING Groep NV 5,750 % éch. 16/11/2026 (g)(i)	900	796	0,02
								Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % éch. 16/03/2028	€ 3 100	2 886	0,09
								3,250 % éch. 23/09/2024	\$ 5 800	5 566	0,16
								4,000 % éch. 23/09/2029	€ 400	348	0,01
								5,148 % éch. 10/06/2030	€ 1 400	1 440	0,04
								JAB Holdings BV 2,200 % éch. 23/11/2030	\$ 4 900	3 857	0,11
								JPMorgan Chase & Co. 2,595 % éch. 24/02/2026	€ 6 400	6 072	0,18
								3,220 % éch. 01/03/2025	€ 3 050	2 990	0,09
								4,005 % éch. 23/04/2029	€ 4 500	4 241	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
Kennedy-Wilson, Inc. 4,750 % éch. 01/02/2030	\$ 3 000	\$ 2 265	0,07	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,000 % éch. 12/08/2027 (k)	€ 1 400	\$ 994	0,03	Air Canada Pass-Through Trust 3,600 % éch. 15/09/2028	\$ 1 035	\$ 962	0,03
Lazard Group LLC 4,375 % éch. 11/03/2029	15 300	14 217	0,42	Santander UK Group Holdings PLC 3,823 % éch. 03/11/2028	\$ 3 100	2 793	0,08	Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % éch. 15/02/2029	884	851	0,03
Legal & General Group PLC 5,625 % éch. 24/03/2031 (g)(i)	€ 800	787	0,02	4,796 % éch. 15/11/2024	8 800	8 734	0,26	Allegiant Travel Co. 7,250 % éch. 15/08/2027	2 600	2 593	0,08
LFS Topco LLC 5,875 % éch. 15/10/2026	\$ 1 500	1 319	0,04	6,750 % éch. 24/06/2024 (g)(i)	€ 400	477	0,01	Altice France S.A. 4,250 % éch. 15/10/2029	€ 2 300	1 812	0,05
Lloyds Banking Group PLC 4,375 % éch. 22/03/2028	900	854	0,03	SELP Finance SARL 3,750 % éch. 10/08/2027	€ 3 300	3 375	0,10	5,500 % éch. 15/10/2029	\$ 2 500	1 790	0,05
4,947 % éch. 27/06/2025 (g)(i)	€ 1 100	1 097	0,03	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % éch. 22/06/2026	4 800	4 330	0,13	AMC Networks, Inc. 4,750 % éch. 01/08/2025	1 700	1 489	0,04
4,976 % éch. 11/08/2033	\$ 2 900	2 714	0,08	Société Générale S.A. 4,677 % éch. 15/06/2027	\$ 3 700	3 568	0,11	American Airlines Pass-Through Trust 3,000 % éch. 15/04/2030	418	372	0,01
Logicor Financing SARL 0,625 % éch. 17/11/2025	€ 300	287	0,01	Sofina S.A. 1,000 % éch. 23/09/2028	€ 2 900	2 534	0,07	3,250 % éch. 15/04/2030	139	118	0,00
1,500 % éch. 13/07/2026	2 300	2 169	0,06	Spirit Realty LP 4,000 % éch. 15/07/2029	\$ 400	352	0,01	3,350 % éch. 15/04/2031	802	714	0,02
1,625 % éch. 17/01/2030	900	728	0,02	Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % (g)	€ 1 996	2 025	0,06	3,375 % éch. 01/11/2028	961	863	0,03
2,000 % éch. 17/01/2034	1 000	726	0,02	STORE Capital Corp. 4,625 % éch. 15/03/2029	\$ 200	169	0,01	3,575 % éch. 15/07/2029	967	897	0,03
2,750 % éch. 15/01/2030	€ 900	842	0,02	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % éch. 06/04/2026	€ 3 300	3 556	0,11	3,700 % éch. 01/04/2028	166	149	0,00
Mitsubishi HC Capital, Inc. 3,960 % éch. 19/09/2023	\$ 600	597	0,02	Synchrony Financial 4,500 % éch. 23/07/2025	\$ 800	755	0,02	American Airlines, Inc. 5,500 % éch. 20/04/2026	1 300	1 289	0,04
Mizuho Financial Group, Inc. 0,470 % éch. 06/09/2029	€ 3 000	2 684	0,08	Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026	€ 23 400	25 495	0,76	5,750 % éch. 20/04/2029	3 900	3 790	0,11
2,564 % éch. 13/09/2031	\$ 1 600	1 260	0,04	TP ICAP Finance PLC 2,625 % éch. 18/11/2028	€ 1 200	1 128	0,03	Bayer U.S. Finance LLC 3,875 % éch. 15/12/2023	400	396	0,01
Morgan Stanley 0,000 % éch. 02/04/2032 (j)	3 600	2 250	0,07	5,250 % éch. 29/05/2026	€ 3 500	4 100	0,12	6,562 % éch. 15/12/2023	200	200	0,01
Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc. 4,500 % éch. 20/06/2028	7 500	7 232	0,21	UBS Group AG 2,125 % éch. 12/09/2025	500	595	0,02	Becton Dickinson Euro Finance SARL 1,336 % éch. 13/08/2041	€ 3 100	2 165	0,06
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal 0,625 % éch. 21/06/2027	€ 1 200	1 119	0,03	3,091 % éch. 14/05/2032	950	769	0,02	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	€ 7 600	8 110	0,24
2,125 % éch. 21/06/2052	3 400	2 564	0,08	3,750 % éch. 26/03/2025	700	670	0,02	Boeing Co. 1,950 % éch. 01/02/2024	\$ 700	684	0,02
National Bank of Canada 3,500 % éch. 25/04/2028	1 800	1 954	0,06	3,869 % éch. 12/01/2029	4 750	4 298	0,13	2,750 % éch. 01/02/2026	5 100	4 751	0,14
Nationwide Building Society 3,960 % éch. 18/07/2030	\$ 900	800	0,02	4,194 % éch. 01/04/2031	2 100	1 870	0,06	British Airways Pass-Through Trust 2,900 % éch. 15/09/2036	1 528	1 263	0,04
4,302 % éch. 08/03/2029	6 800	6 306	0,19	4,375 % éch. 10/02/2031 (g)(i)	1 300	919	0,03	4,250 % éch. 15/05/2034	674	616	0,02
4,363 % éch. 01/08/2024	2 000	1 996	0,06	4,550 % éch. 17/04/2026	1 200	1 154	0,03	Broadcom, Inc. 3,137 % éch. 15/11/2035	4	3	0,00
5,875 % éch. 20/12/2024 (g)(i)	€ 1 600	1 902	0,06	4,703 % éch. 05/08/2027	1 400	1 339	0,04	4,926 % éch. 15/05/2037	4	4	0,00
NatWest Group PLC 2,000 % éch. 04/03/2025	€ 4 500	4 820	0,14	6,442 % éch. 01/08/2028	4 750	4 772	0,14	Caesars Entertainment, Inc. 6,250 % éch. 01/07/2025	400	399	0,01
4,892 % éch. 18/05/2029	\$ 1 700	1 619	0,05	7,750 % éch. 01/03/2029	€ 400	484	0,01	Carnival Holdings Bermuda Ltd. 10,375 % éch. 01/05/2028	2 500	2 737	0,08
5,125 % éch. 12/05/2027 (g)(i)	€ 200	210	0,01	UniCredit SpA 2,569 % éch. 22/09/2026	\$ 350	316	0,01	CCO Holdings LLC 5,000 % éch. 01/02/2028	1 550	1 414	0,04
NatWest Markets PLC 1,000 % éch. 28/05/2024	€ 1 700	1 803	0,05	7,830 % éch. 04/12/2023	12 000	12 072	0,36	Charter Communications Operating LLC 3,500 % éch. 01/06/2041	2 000	1 354	0,04
Nissan Motor Acceptance Co. LLC 1,850 % éch. 16/09/2026	\$ 1 600	1 358	0,04	Ursa Re Ltd. 9,208 % éch. 07/12/2027	6 000	5 976	0,18	3,900 % éch. 01/06/2052	1 900	1 245	0,04
2,000 % éch. 09/03/2026	1 400	1 226	0,04	VICI Properties LP 3,500 % éch. 15/02/2025	1 700	1 626	0,05	4,908 % éch. 23/07/2025	2 970	2 913	0,09
2,450 % éch. 15/09/2028	700	559	0,02	3,750 % éch. 15/02/2027	3 300	3 030	0,09	6,384 % éch. 23/10/2035	875	853	0,03
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % éch. 05/02/2030	€ 2 500	2 318	0,07	4,125 % éch. 15/08/2030	2 500	2 203	0,07	6,484 % éch. 23/10/2045	1 100	1 035	0,03
3,650 % éch. 19/11/2029	2 900	2 689	0,08	4,750 % éch. 15/02/2028	2 300	2 180	0,06	6,834 % éch. 23/10/2055	150	142	0,00
Nuveen Finance LLC 4,125 % éch. 01/11/2024	\$ 500	486	0,01	Virgin Money UK PLC 3,375 % éch. 24/04/2026	€ 200	232	0,01	Cigna Group 3,750 % éch. 15/07/2023	794	793	0,02
Ohio National Financial Services, Inc. 6,800 % éch. 24/01/2030	3 500	3 258	0,10	Volkswagen Financial Services NV 0,875 % éch. 20/02/2025	3 200	3 705	0,11	Cloud Software Group, Inc. 6,500 % éch. 31/03/2029	3 800	3 387	0,10
OneMain Finance Corp. 6,125 % éch. 15/03/2024	2 650	2 643	0,08	2,750 % éch. 10/07/2023	2 400	3 050	0,09	Constellation Oil Services Holding S.A. 13,500 % éch. 30/06/2025	341	336	0,01
Owl Rock Capital Corp. 2,875 % éch. 11/06/2028	1 900	1 550	0,05	Wells Fargo & Co. 3,000 % éch. 22/04/2026	\$ 2 100	1 976	0,06	Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)	944	559	0,02
Park Aerospace Holdings Ltd. 5,500 % éch. 15/02/2024	28	28	0,00	3,526 % éch. 24/03/2028	2 600	2 429	0,07	Coty, Inc. 3,875 % éch. 15/04/2026	€ 4 200	4 453	0,13
Piper Sandler Cos. 5,200 % éch. 15/10/2023	3 600	3 591	0,11	Workspace Group PLC 2,250 % éch. 11/03/2028	€ 2 700	2 517	0,07	4,750 % éch. 15/01/2029	\$ 2 000	1 846	0,05
PRA Group, Inc. 7,375 % éch. 01/09/2025	1 100	1 047	0,03	WPC Eurobond BV 1,350 % éch. 15/04/2028	€ 1 700	1 577	0,05	DAE Funding LLC 1,625 % éch. 15/02/2024	2 500	2 411	0,07
Prologis International Funding S.A. 3,125 % éch. 01/06/2031	€ 2 200	2 128	0,06	INDUSTRIE				DISH DBS Corp. 5,250 % éch. 01/12/2026	1 000	804	0,02
RLJ Lodging Trust LP 3,750 % éch. 01/07/2026	\$ 1 600	1 469	0,04	AA Bond Co. Ltd. 3,250 % éch. 31/07/2050	€ 2 300	2 228	0,07	5,750 % éch. 01/12/2028	2 000	1 491	0,04
Sagax AB 1,125 % éch. 30/01/2027	€ 3 800	3 499	0,10	Accor S.A. 2,375 % éch. 29/11/2028	€ 3 500	3 437	0,10	DISH Network Corp. 11,750 % éch. 15/11/2027	6 400	6 253	0,19
2,000 % éch. 17/01/2024	190	203	0,01	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. 3,100 % éch. 02/02/2031	\$ 5 000	3 503	0,10	Exela Intermediate LLC 11,500 % éch. 15/07/2026	1 126	107	0,00
2,250 % éch. 13/03/2025	2 200	2 268	0,07	3,375 % éch. 24/07/2024	3 287	3 142	0,09	Expedia Group, Inc. 2,950 % éch. 15/03/2031	540	456	0,01
Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % éch. 26/01/2028	2 200	1 821	0,05	Aeroporto di Roma SpA 1,750 % éch. 30/07/2031	€ 3 800	3 367	0,10	6,250 % éch. 01/05/2025	2 069	2 077	0,06
1,000 % éch. 17/05/2029	1 200	934	0,03	Air Canada 3,875 % éch. 15/08/2026	\$ 1 300	1 206	0,04	Ford Motor Co. 3,250 % éch. 12/02/2032	1 300	1 024	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
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA											
2,500 % éch. 01/08/2053	\$ 30 200	\$ 25 651	0,76	4,336 % éch. 25/01/2035	\$ 35	\$ 31	0,00	5,500 % éch. 25/04/2035	\$ 120	\$ 85	0,00
3,000 % éch. 01/08/2053	50 300	44 341	1,32	4,374 % éch. 25/08/2033	98	94	0,00	5,500 % éch. 25/09/2035 ^	241	148	0,00
3,500 % éch. 01/08/2053	119 800	109 294	3,25	4,513 % éch. 25/04/2033	3	3	0,00	5,500 % éch. 25/11/2035 ^	171	103	0,00
4,000 % éch. 01/08/2053	160 200	150 482	4,47	4,517 % éch. 25/01/2035	22	21	0,00	5,500 % éch. 25/12/2035 ^	106	47	0,00
4,500 % éch. 01/07/2053	120 300	115 689	3,44	4,670 % éch. 25/11/2034	38	32	0,00	5,500 % éch. 25/12/2035 ^	3 167	2 074	0,06
5,000 % éch. 01/08/2053	192 600	188 763	5,60	4,752 % éch. 25/07/2034	43	40	0,00	5,500 % éch. 25/12/2035 ^	1 077	483	0,01
				Bear Stearns ALT-A Trust				5,500 % éch. 25/01/2036	21	13	0,00
				3,250 % éch. 25/02/2034	8	7	0,00	5,500 % éch. 25/05/2036 ^	418	327	0,01
				3,634 % éch. 25/09/2035 ^	3 846	1 654	0,05	5,510 % éch. 25/05/2047	800	689	0,02
				3,651 % éch. 25/04/2035	46	39	0,00	5,520 % éch. 25/02/2037 ^	1 963	600	0,02
				3,731 % éch. 25/11/2036 ^	1 198	568	0,02	5,530 % éch. 25/07/2046 ^	296	286	0,01
				3,781 % éch. 25/11/2036	3 175	1 803	0,05	5,530 % éch. 25/09/2046 ^	17	16	0,00
				3,920 % éch. 25/09/2034	95	88	0,00	5,577 % éch. 25/03/2046	51	42	0,00
				3,971 % éch. 25/05/2036 ^	489	247	0,01	5,577 % éch. 25/05/2046 ^	300	255	0,01
				3,989 % éch. 25/03/2036 ^	224	171	0,01	5,630 % éch. 25/01/2037	2 202	1 794	0,05
				4,195 % éch. 25/05/2035	304	287	0,01	5,710 % éch. 25/02/2037	753	623	0,02
				4,812 % éch. 25/01/2034	43	38	0,00	5,730 % éch. 25/02/2036 ^	1 683	1 490	0,04
				5,490 % éch. 25/02/2034	136	121	0,00	5,750 % éch. 25/02/2035	140	100	0,00
				5,490 % éch. 25/08/2036 ^	179	170	0,01	5,750 % éch. 25/07/2035 ^	675	435	0,01
				5,550 % éch. 25/02/2034	672	600	0,02	5,750 % éch. 25/05/2036	434	186	0,01
				5,590 % éch. 25/04/2036 ^	415	352	0,01	5,750 % éch. 25/03/2037 ^	389	221	0,01
				5,630 % éch. 25/02/2036	299	261	0,01	5,803 % éch. 20/11/2035	21	18	0,00
				Bear Stearns Mortgage Funding Trust				5,860 % éch. 25/07/2036 ^	552	209	0,01
				5,330 % éch. 25/06/2037	611	552	0,02	6,000 % éch. 25/10/2035 ^	1 316	917	0,03
				Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				6,000 % éch. 25/04/2036	594	308	0,01
				3,484 % éch. 26/12/2046 ^	456	344	0,01	6,000 % éch. 25/04/2036 ^	120	62	0,00
				Canada Square Funding PLC				6,000 % éch. 25/04/2036 ^	95	51	0,00
				5,316 % éch. 17/01/2059	£ 2 291	2 896	0,09	6,000 % éch. 25/08/2036 ^	122	76	0,00
				Canterbury Finance PLC				6,000 % éch. 25/12/2036 ^	1 243	545	0,02
				5,377 % éch. 16/05/2058	392	498	0,02	6,000 % éch. 25/02/2037 ^	227	104	0,00
				Charter Mortgage Funding PLC				6,000 % éch. 25/03/2037 ^	287	115	0,00
				5,327 % éch. 16/01/2057	1 429	1 815	0,05	6,000 % éch. 25/04/2037 ^	559	277	0,01
				Chase Mortgage Finance Trust				6,000 % éch. 25/05/2037 ^	94	48	0,00
				3,848 % éch. 25/03/2037 ^	\$ 326	297	0,01	6,000 % éch. 25/08/2037 ^	645	335	0,01
				4,086 % éch. 25/03/2037 ^	26	25	0,00	6,050 % éch. 25/12/2036 ^	645	216	0,01
				4,483 % éch. 25/02/2037	15	15	0,00	6,500 % éch. 25/08/2032	40	39	0,00
				ChaseFlex Trust				6,500 % éch. 25/09/2037 ^	562	231	0,01
				5,750 % éch. 25/07/2037	11	9	0,00	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
				ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				3,514 % éch. 25/04/2035	29	23	0,00
				4,176 % éch. 25/08/2037 ^	552	471	0,01	3,573 % éch. 20/05/2036 ^	648	596	0,02
				4,176 % éch. 25/08/2037 ^	247	205	0,01	3,677 % éch. 20/02/2036	496	425	0,01
				Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				3,734 % éch. 20/04/2036 ^	2	2	0,00
				5,330 % éch. 25/05/2036	27	24	0,00	3,937 % éch. 20/05/2036	361	325	0,01
				Citicorp Mortgage Securities Trust				4,241 % éch. 20/07/2034	76	70	0,00
				6,000 % éch. 25/09/2037	34	32	0,00	5,250 % éch. 25/12/2027 ^	22	14	0,00
				Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.				5,500 % éch. 25/11/2035 ^	4	2	0,00
				5,650 % éch. 25/05/2032	27	27	0,00	5,610 % éch. 25/05/2035	36	30	0,00
				Citigroup Mortgage Loan Trust				5,730 % éch. 25/04/2035	26	24	0,00
				3,620 % éch. 25/10/2046 ^	306	272	0,01	5,730 % éch. 25/04/2035	14	13	0,00
				4,288 % éch. 25/07/2037 ^	8	7	0,00	5,750 % éch. 25/02/2037 ^	365	175	0,01
				4,321 % éch. 25/03/2034	68	64	0,00	5,750 % éch. 25/05/2037 ^	23	12	0,00
				4,418 % éch. 25/08/2035	42	41	0,00	5,750 % éch. 25/08/2037	2 073	1 133	0,03
				5,351 % éch. 25/09/2037 ^	82	72	0,00	5,810 % éch. 25/03/2035	265	219	0,01
				6,470 % éch. 25/11/2035	68	67	0,00	5,910 % éch. 25/02/2035	37	32	0,00
				6,980 % éch. 25/05/2035	43	42	0,00	5,980 % éch. 25/02/2035	773	668	0,02
				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				5,910 % éch. 20/02/2036 ^	25	21	0,00
				4,183 % éch. 25/02/2034	12	11	0,00	6,000 % éch. 25/09/2037 ^	85	46	0,00
				6,430 % éch. 25/09/2035	1	1	0,00	6,500 % éch. 25/12/2037	1 430	629	0,02
				CitiMortgage Alternative Loan Trust				Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
				5,750 % éch. 25/01/2037	1 114	920	0,03	6,500 % éch. 25/11/2034 ^	15	13	0,00
				5,750 % éch. 25/06/2037	1 603	1 312	0,04	6,500 % éch. 25/03/2035 ^	403	389	0,01
				5,800 % éch. 25/09/2036	1 494	1 228	0,04	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
				6,000 % éch. 25/10/2037 ^	684	600	0,02	5,449 % éch. 25/03/2032	27	25	0,00
				Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				6,000 % éch. 25/01/2036 ^	480	306	0,01
				6,000 % éch. 25/05/2036 ^	98	59	0,00	6,500 % éch. 25/04/2033	3	3	0,00
				Countrywide Alternative Loan Trust				Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through Certificates			
				0,000 % éch. 25/12/2035 (a)	1 075	66	0,00	5,276 % éch. 25/10/2033	8	8	0,00
				4,976 % éch. 25/12/2035	2 209	1 861	0,06	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
				5,000 % éch. 25/03/2035	5	4	0,00	3,519 % éch. 30/11/2037	3 809	3 497	0,10
				5,337 % éch. 20/02/2047 ^	319	249	0,01	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
				5,347 % éch. 20/03/2047	5 058	4 166	0,12	5,750 % éch. 25/02/2037	3 804	1 801	0,05
				5,350 % éch. 25/04/2047	224	211	0,01	6,250 % éch. 25/08/2036 ^	43	17	0,00
				5,352 % éch. 20/12/2046 ^	11 118	9 317	0,28	7,000 % éch. 25/08/2037 ^	375	240	0,01
				5,430 % éch. 25/06/2037	681	613	0,02	Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
				5,430 % éch. 25/04/2047	1 212	1 080	0,03	3,474 % éch. 25/06/2050	1 844	1 548	0,05
				5,437 % éch. 20/09/2046	578	416	0,01	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
				5,470 % éch. 25/09/2047	575	499	0,02	5,290 % éch. 25/07/2047	373	341	0,01
				5,490 % éch. 25/05/2047	563	485	0,01	5,450 % éch. 25/03/2037 ^	238	225	0,01
								5,450 % éch. 25/09/2047 ^	688	586	0,02
								5,480 % éch. 25/08/2037 ^	1 400	1 187	0,04

Tableau des investissements Fonds Dynamic 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
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				JPMorgan Alternative Loan Trust				RBSPP Resecuritization Trust			
5,235 % éch. 19/07/2044	\$ 192	\$ 175	0,01	3,814 % éch. 25/03/2036 ^	\$ 201	\$ 147	0,00	5,378 % éch. 27/06/2036	\$ 4 946	\$ 3 915	0,12
5,347 % éch. 19/10/2036	611	507	0,02	5,510 % éch. 25/06/2037	9 361	5 107	0,15	Residential Accredited Loans, Inc. Trust			
Dutch Property Finance BV				5,843 % éch. 26/05/2037	1 014	766	0,02	4,398 % éch. 25/10/2037	168	149	0,00
3,892 % éch. 28/07/2054	€ 1 369	1 490	0,04	JPMorgan Mortgage Trust				4,834 % éch. 25/12/2035 ^	158	129	0,00
EMF-NL Prime BV				3,655 % éch. 27/07/2037	126	114	0,00	4,951 % éch. 25/01/2036 ^	205	147	0,00
3,977 % éch. 17/04/2041	1 163	1 213	0,04	3,921 % éch. 25/11/2035 ^	21	17	0,00	5,300 % éch. 25/02/2047	2 608	987	0,03
European Loan Conduit DAC				3,963 % éch. 25/12/2034	18	17	0,00	5,450 % éch. 25/08/2035	192	146	0,00
4,358 % éch. 17/02/2030	4 109	4 389	0,13	3,987 % éch. 25/05/2034	6	5	0,00	5,476 % éch. 25/08/2035	51	42	0,00
Eurosail BV				4,078 % éch. 25/10/2035 ^	152	122	0,00	5,530 % éch. 25/09/2036 ^	647	598	0,02
4,677 % éch. 17/10/2040	270	295	0,01	4,172 % éch. 25/04/2036 ^	8	6	0,00	5,530 % éch. 25/12/2036	371	325	0,01
Eurosail PLC				5,750 % éch. 25/01/2036 ^	52	26	0,00	5,550 % éch. 25/05/2047	359	320	0,01
3,719 % éch. 13/03/2045	3 632	3 694	0,11	6,000 % éch. 25/08/2037 ^	262	142	0,00	5,550 % éch. 25/11/2036 ^	108	76	0,00
5,240 % éch. 13/03/2045	€ 7 250	8 623	0,26	6,250 % éch. 25/07/2036 ^	144	96	0,00	5,650 % éch. 25/08/2037	93	85	0,00
5,463 % éch. 10/06/2044	6 316	7 695	0,23	6,500 % éch. 25/08/2036 ^	251	51	0,00	5,710 % éch. 25/12/2045	67	53	0,00
5,940 % éch. 13/06/2045	10 049	12 343	0,37	Jubilee Place BV				6,000 % éch. 25/08/2036 ^	304	248	0,01
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				4,177 % éch. 17/10/2057	€ 443	484	0,01	6,500 % éch. 25/09/2037 ^	110	88	0,00
4,902 % éch. 25/01/2036 ^	\$ 313	168	0,01	Lehman Mortgage Trust				Residential Asset Securitization Trust			
5,184 % éch. 25/09/2034	45	40	0,00	5,890 % éch. 25/04/2036 ^	\$ 1 032	681	0,02	5,500 % éch. 25/06/2033	42	39	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				Lehman XS Trust				5,500 % éch. 25/09/2035 ^	17	8	0,00
4,715 % éch. 25/08/2035	24	17	0,00	5,600 % éch. 25/08/2046	145	140	0,00	5,500 % éch. 25/12/2035 ^	81	40	0,00
Friary PLC				6,050 % éch. 25/08/2047 ^	503	422	0,01	5,750 % éch. 25/02/2036 ^	125	51	0,00
5,467 % éch. 21/11/2067	€ 574	733	0,02	Luminant Mortgage Trust				6,000 % éch. 25/07/2037 ^	387	168	0,01
GMAC Mortgage Corp. Loan Trust				5,510 % éch. 25/12/2036 ^	18	17	0,00	6,250 % éch. 25/08/2037	2 324	642	0,02
3,281 % éch. 19/04/2036 ^	\$ 45	36	0,00	Mansard Mortgages PLC				Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
Great Hall Mortgages PLC				4,885 % éch. 15/04/2049	€ 3 064	3 605	0,11	4,149 % éch. 25/09/2035 ^	325	211	0,01
5,644 % éch. 18/06/2039	15	15	0,00	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				4,573 % éch. 25/04/2037 ^	30	23	0,00
Greenpoint Mortgage Funding Trust				3,244 % éch. 25/07/2035 ^	\$ 183	157	0,01	4,978 % éch. 27/07/2037 ^	257	211	0,01
5,690 % éch. 25/11/2045	147	130	0,00	4,265 % éch. 25/05/2034	49	44	0,00	6,500 % éch. 25/03/2032	23	22	0,00
5,770 % éch. 25/10/2045	12	11	0,00	4,600 % éch. 21/11/2034	116	109	0,00	RESIMAC Bastille Trust			
GSR Mortgage Loan Trust				MASTR Seasoned Securitization Trust				6,093 % éch. 05/09/2057	1 072	1 072	0,03
1,500 % éch. 25/01/2037 (a)	3 079	295	0,01	4,590 % éch. 25/10/2032	70	68	0,00	Resloc UK PLC			
3,657 % éch. 25/11/2035	55	49	0,00	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				3,706 % éch. 15/12/2043	€ 2 163	2 169	0,07
3,957 % éch. 25/11/2035 ^	90	52	0,00	5,893 % éch. 15/11/2031	22	21	0,00	3,776 % éch. 15/12/2043	4 251	4 206	0,13
4,070 % éch. 25/09/2035	141	133	0,00	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				5,221 % éch. 15/12/2043	€ 5 802	6 948	0,21
5,750 % éch. 25/03/2036 ^	9	9	0,00	5,633 % éch. 15/12/2030	204	193	0,01	Rochester Financing PLC			
5,750 % éch. 25/01/2037 ^	18	11	0,00	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				5,602 % éch. 18/12/2044	1 640	2 060	0,06
6,000 % éch. 25/03/2032	0	0	0,00	3,738 % éch. 25/03/2036 ^	497	280	0,01	Sequoia Mortgage Trust			
6,000 % éch. 25/11/2035 ^	832	344	0,01	3,918 % éch. 25/05/2033	52	50	0,00	3,271 % éch. 20/01/2047 ^	\$ 135	89	0,00
6,000 % éch. 25/03/2037 ^	47	27	0,00	4,159 % éch. 25/02/2035	11	10	0,00	4,601 % éch. 20/04/2035	47	46	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037 ^	126	92	0,00	4,343 % éch. 25/07/2035 ^	31	28	0,00	5,840 % éch. 20/07/2033	23	20	0,00
6,500 % éch. 25/09/2036 ^	79	39	0,00	5,650 % éch. 25/11/2035	42	40	0,00	Shamrock Residential DAC			
HarborView Mortgage Loan Trust				5,823 % éch. 25/10/2028	12	11	0,00	4,289 % éch. 24/01/2061	€ 2 895	3 126	0,09
3,687 % éch. 19/10/2033	28	24	0,00	7,119 % éch. 25/12/2032	5	4	0,00	Stratton BTL Mortgage Funding PLC			
4,423 % éch. 19/06/2045 ^	1 099	562	0,02	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				5,221 % éch. 20/01/2054	€ 3 139	3 970	0,12
5,310 % éch. 25/05/2038	485	389	0,01	3,103 % éch. 25/11/2037	1 568	1 038	0,03	Stratton Mortgage Funding PLC			
5,597 % éch. 19/05/2035	142	130	0,00	3,732 % éch. 25/12/2037	1 280	890	0,03	5,765 % éch. 12/03/2052	1 571	1 990	0,06
5,657 % éch. 19/01/2036	671	416	0,01	5,410 % éch. 25/04/2035	41	39	0,00	5,991 % éch. 20/07/2060	10 705	13 552	0,40
5,717 % éch. 19/02/2036	222	116	0,00	5,962 % éch. 25/06/2036 ^	734	222	0,01	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
5,977 % éch. 19/11/2034 ^	77	65	0,00	6,354 % éch. 25/08/2036 ^	786	157	0,01	3,853 % éch. 25/04/2036 ^	\$ 119	73	0,00
Harmony French Home Loans				Morgan Stanley Re-REMIC Trust				4,455 % éch. 25/09/2035	79	71	0,00
4,107 % éch. 27/05/2062	€ 6 132	6 719	0,20	5,250 % éch. 26/05/2037	864	454	0,01	4,702 % éch. 25/04/2035	134	126	0,00
HomeBanc Mortgage Trust				MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust				4,968 % éch. 25/10/2035 ^	162	145	0,00
3,912 % éch. 25/04/2037 ^	\$ 1 616	1 414	0,04	5,610 % éch. 25/06/2047	1 445	1 175	0,04	4,984 % éch. 25/09/2034	226	215	0,01
Impac CMB Trust				Newgate Funding PLC				5,282 % éch. 25/02/2034	116	109	0,00
5,790 % éch. 25/09/2034	2	2	0,00	3,420 % éch. 01/12/2050	€ 3 974	4 134	0,12	5,404 % éch. 25/04/2035	250	231	0,01
5,790 % éch. 25/03/2035	331	303	0,01	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				5,450 % éch. 25/09/2034	4	3	0,00
5,810 % éch. 25/03/2035	329	300	0,01	3,834 % éch. 25/10/2035	\$ 121	70	0,00	5,578 % éch. 25/07/2034	121	116	0,00
5,930 % éch. 25/10/2034	254	247	0,01	4,680 % éch. 25/06/2036	1 301	984	0,03	5,701 % éch. 25/04/2034	1	0	0,00
6,070 % éch. 25/11/2034	14	14	0,00	6,220 % éch. 25/02/2035	296	291	0,01	6,063 % éch. 25/12/2034	14	13	0,00
IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust				NovaStar Mortgage Funding Trust				Structured Asset Mortgage Investments Trust			
3,686 % éch. 25/01/2032	13	12	0,00	0,440 % éch. 25/09/2046	1 873	656	0,02	5,270 % éch. 25/08/2036	638	554	0,02
IndyMac Mortgage Loan Trust				OBX Trust				5,490 % éch. 25/03/2037 ^	63	18	0,00
3,082 % éch. 25/06/2037	866	479	0,01	5,800 % éch. 25/06/2057	179	170	0,01	5,510 % éch. 25/07/2046	380	316	0,01
3,334 % éch. 25/07/2037	2 042	1 333	0,04	Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,530 % éch. 25/06/2036	59	58	0,00
3,717 % éch. 25/06/2036	251	216	0,01	5,675 % éch. 25/12/2035	0	0	0,00	5,550 % éch. 25/10/2036	1 272	1 110	0,03
3,747 % éch. 25/06/2037 ^	64	44	0,00	Polaris PLC				5,570 % éch. 25/04/2036	306	271	0,01
3,917 % éch. 25/07/2037	454	191	0,01	6,154 % éch. 27/05/2057	€ 1 263	1 608	0,05	5,570 % éch. 25/08/2036 ^	61	50	0,00
4,009 % éch. 25/10/2034	212	202	0,01	Precise Mortgage Funding PLC				5,646 % éch. 19/07/2035	126	119	0,00
5,510 % éch. 25/07/2047	583	406	0,01	5,657 % éch. 16/10/2056	459	583	0,02	5,770 % éch. 25/12/2035 ^	164	133	0,00
5,570 % éch. 25/07/2036	761	702	0,02	Prime Mortgage Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates			
5,750 % éch. 25/07/2035	210	171	0,01	8,000 % éch. 25/07/2034	\$ 334	259	0,01	6,434 % éch. 25/12/2033	63	59	0,00
5,790 % éch. 25/02/2035	55	49	0,00	RBSGC Structured Trust				6,639 % éch. 25/06/2033	1	1	0,00
5,950 % éch. 25/11/2034	96	86	0,00	5,500 % éch. 25/11/2035 ^	734	617	0,02	Thornburg Mortgage Securities Trust			
5,970 % éch. 25/11/2034 ^	70	60	0,00					3,889 % éch. 25/07/2036	148	122	0,00
6,500 % éch. 25/07/2037 ^	3 037	1 006	0,03					5,830 % éch. 25/04/2043	11	11	0,00
								6,400 % éch. 25/06/2037 ^	375	344	0,01
								7,151 % éch. 25/06/2037	2 288	1 951	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
Towd Point Mortgage Funding PLC				4,325 % éch. 21/10/2033	8 500	9 120	0,27	5,400 % éch. 25/10/2036	\$ 936	\$ 735	0,02
5,635 % éch. 20/10/2051	£ 11 512	\$ 14 657	0,44	Argent Securities Trust				5,630 % éch. 25/06/2036	1 053	998	0,03
5,841 % éch. 20/07/2045	2 938	3 738	0,11	5,300 % éch. 25/09/2036	\$ 2 031	669	0,02	6,050 % éch. 25/05/2034	421	402	0,01
Tower Bridge Funding PLC				5,370 % éch. 25/05/2036	542	135	0,00	Centex Home Equity Loan Trust			
5,629 % éch. 20/12/2063	2 170	2 746	0,08	5,450 % éch. 25/06/2036	1 692	473	0,01	6,080 % éch. 25/09/2034	305	293	0,01
Trinity Square PLC				5,450 % éch. 25/07/2036	5 817	4 961	0,15	CIT Mortgage Loan Trust			
5,316 % éch. 15/07/2059	2 039	2 589	0,08	5,470 % éch. 25/05/2036	3 630	900	0,03	6,500 % éch. 25/10/2037	357	357	0,01
Twin Bridges PLC				Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				6,650 % éch. 25/10/2037	10 500	10 222	0,30
5,715 % éch. 12/03/2055	3 581	4 536	0,14	5,630 % éch. 25/05/2035	2 000	1 803	0,05	Citigroup Mortgage Loan Trust			
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Armada Euro CLO DAC				5,320 % éch. 25/07/2045	1 345	939	0,03
3,320 % éch. 25/05/2037 ^	\$ 27	21	0,00	3,897 % éch. 15/07/2031	€ 1 549	1 654	0,05	5,350 % éch. 25/05/2037	4 048	2 671	0,08
3,704 % éch. 25/02/2037 ^	152	128	0,00	Asset-Backed Funding Certificates Trust				5,470 % éch. 25/12/2036	249	162	0,01
3,727 % éch. 25/12/2046	180	171	0,01	5,260 % éch. 25/01/2037	\$ 1 011	586	0,02	5,650 % éch. 25/08/2036	2 644	2 564	0,08
3,754 % éch. 25/09/2036 ^	318	273	0,01	5,310 % éch. 25/01/2037	413	239	0,01	5,670 % éch. 25/09/2036	678	589	0,02
3,754 % éch. 25/09/2036 ^	318	273	0,01	5,850 % éch. 25/06/2034	712	692	0,02	7,250 % éch. 25/05/2036	539	287	0,01
3,772 % éch. 25/02/2037 ^	1 204	1 081	0,03	6,200 % éch. 25/03/2034 ^	352	328	0,01	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates			
3,824 % éch. 25/06/2037 ^	74	66	0,00	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				6,095 % éch. 25/10/2034	315	298	0,01
3,883 % éch. 25/03/2036	10	9	0,00	6,245 % éch. 25/02/2035	822	830	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
4,008 % éch. 25/12/2046	115	102	0,00	Aurium CLO DAC				5,410 % éch. 25/03/2037	418	354	0,01
4,134 % éch. 25/08/2034	74	70	0,00	3,907 % éch. 16/01/2031	€ 5 692	6 090	0,18	Clarinda Park CLO DAC			
4,163 % éch. 25/09/2033	21	19	0,00	4,618 % éch. 23/03/2032	5 000	5 373	0,16	4,223 % éch. 15/02/2034	€ 7 550	8 044	0,24
4,220 % éch. 25/10/2034	2	2	0,00	Avoca CLO DAC				Contego CLO DAC			
4,280 % éch. 25/03/2034	259	255	0,01	3,867 % éch. 15/07/2030	4 285	4 598	0,14	3,851 % éch. 23/01/2030	4 189	4 480	0,13
4,676 % éch. 25/02/2047 ^	600	512	0,02	3,885 % éch. 12/01/2031	2 154	2 308	0,07	Countrywide Asset-Backed Certificates			
4,706 % éch. 25/01/2047	160	150	0,01	4,067 % éch. 15/04/2033	3 500	3 728	0,11	5,830 % éch. 25/12/2036 ^	\$ 89	66	0,00
4,716 % éch. 25/01/2047 ^	55	50	0,00	Babson CLO Ltd.				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
4,726 % éch. 25/06/2047 ^	5	3	0,00	6,240 % éch. 20/01/2031	\$ 5 575	5 528	0,16	4,450 % éch. 25/10/2032 ^	1 002	974	0,03
4,736 % éch. 25/04/2047	1 035	913	0,03	Barings CLO Ltd.				4,473 % éch. 25/07/2036	2 669	2 386	0,07
4,956 % éch. 25/06/2046	273	250	0,01	6,210 % éch. 15/04/2031	5 000	4 938	0,15	5,290 % éch. 25/06/2035	430	374	0,01
4,976 % éch. 25/02/2046	340	303	0,01	Barings Euro CLO DAC				5,290 % éch. 25/07/2037	1 222	1 111	0,03
4,976 % éch. 25/08/2046	370	346	0,01	4,302 % éch. 25/11/2029	€ 2 327	2 526	0,08	5,290 % éch. 25/08/2037 ^	157	138	0,00
5,024 % éch. 25/07/2046	238	200	0,01	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				5,330 % éch. 25/11/2047 ^	46	51	0,00
5,024 % éch. 25/08/2046	2 851	2 350	0,07	4,037 % éch. 25/07/2036	\$ 43	41	0,00	5,350 % éch. 25/09/2037	640	556	0,02
5,376 % éch. 25/06/2042	10	9	0,00	4,477 % éch. 25/11/2035 ^	768	721	0,02	5,350 % éch. 25/06/2047 ^	5 072	4 389	0,13
5,376 % éch. 25/08/2042	45	43	0,00	4,800 % éch. 25/06/2043	51	45	0,00	5,360 % éch. 25/05/2047 ^	1 916	1 667	0,05
5,476 % éch. 25/11/2046	1 981	1 748	0,05	5,087 % éch. 25/08/2034	146	141	0,00	5,370 % éch. 25/09/2037 ^	255	256	0,01
5,670 % éch. 25/11/2045	786	729	0,02	5,368 % éch. 25/02/2036	1 262	1 258	0,04	5,370 % éch. 25/09/2047 ^	1 714	1 639	0,05
5,730 % éch. 25/07/2045	129	120	0,00	5,480 % éch. 25/02/2037	3 784	3 442	0,10	5,610 % éch. 25/05/2037	236	222	0,01
5,730 % éch. 25/10/2045	205	194	0,01	5,580 % éch. 25/11/2036	1 124	1 081	0,03	5,859 % éch. 25/10/2046 ^	17	17	0,00
5,990 % éch. 25/07/2045	202	190	0,01	5,500 % éch. 25/08/2036	13	13	0,00	6,095 % éch. 25/08/2035	124	118	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				6,005 % éch. 25/07/2034	1 529	1 472	0,04	6,245 % éch. 25/04/2036 ^	300	282	0,01
4,696 % éch. 25/12/2046	3 124	2 543	0,08	6,200 % éch. 25/08/2037	93	78	0,00	6,875 % éch. 25/05/2035	752	739	0,02
5,470 % éch. 25/02/2037 ^	209	159	0,01	Belle Haven ABS CDO Ltd.				7,100 % éch. 25/08/2035	1 485	1 365	0,04
5,500 % éch. 25/07/2035 ^	395	355	0,01	5,156 % éch. 03/11/2044	11 399	3 438	0,10	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
5,750 % éch. 25/11/2035 ^	319	280	0,01	Black Diamond CLO DAC				4,599 % éch. 25/01/2032	2	2	0,00
5,750 % éch. 25/10/2036 ^	339	264	0,01	4,060 % éch. 20/01/2032	€ 1 088	1 170	0,04	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
5,750 % éch. 25/07/2036 ^	1 356	774	0,02	4,303 % éch. 15/05/2032	5 500	5 871	0,17	3,044 % éch. 25/12/2036 ^	574	457	0,01
6,000 % éch. 25/10/2035 ^	144	108	0,00	Blackrock European CLO DAC				Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust			
6,000 % éch. 25/03/2036 ^	258	239	0,01	3,797 % éch. 15/10/2031	3 100	3 305	0,10	3,287 % éch. 25/03/2037 ^	9 571	3 650	0,11
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust				BlueMountain CLO Ltd.				Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
3,610 % éch. 25/02/2033	0	0	0,00	6,340 % éch. 15/07/2031	\$ 3 900	3 849	0,11	2,959 % éch. 25/01/2037 ^	141	44	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				3,075 % éch. 25/07/2036	1 974	1 839	0,05
5,500 % éch. 25/06/2037 ^	247	174	0,01	1,050 % éch. 15/01/2031	€ 497	500	0,02	3,156 % éch. 25/01/2037 ^	145	45	0,00
		278 047	8,26	3,897 % éch. 15/01/2031	9 445	10 096	0,30	CSAB Mortgage-Backed Trust			
				4,007 % éch. 15/04/2034	2 200	2 340	0,07	6,220 % éch. 25/09/2036 ^	3 475	1 157	0,03
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				BNPP AM Euro CLO DAC				CVC Cordatus Loan Fund DAC			
Accredited Mortgage Loan Trust				3,827 % éch. 15/10/2031	1 478	1 577	0,05	3,855 % éch. 21/07/2030	€ 12 782	13 715	0,41
6,095 % éch. 25/09/2035	6 171	4 990	0,15	4,031 % éch. 22/07/2032	5 800	6 183	0,18	4,156 % éch. 15/09/2031	2 999	3 202	0,10
Accunia European CLO DAC				Bosphorus CLO DAC				4,305 % éch. 26/08/2032	500	534	0,02
4,107 % éch. 15/10/2030	€ 1 939	2 100	0,06	4,346 % éch. 15/12/2030	1 202	1 291	0,04	Delta Funding Home Equity Loan Trust			
4,127 % éch. 15/07/2030	2 981	3 211	0,10	4,496 % éch. 12/12/2032	3 400	3 627	0,11	6,013 % éch. 15/09/2029	\$ 5	5	0,00
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				Cairn CLO BV				Dryden Euro CLO DAC			
5,390 % éch. 25/08/2036 ^	\$ 1 537	390	0,01	3,957 % éch. 15/10/2031	5 300	5 668	0,17	3,837 % éch. 15/04/2033	€ 8 900	9 498	0,28
5,975 % éch. 25/12/2045 ^	983	745	0,02	Cairn CLO DAC				4,157 % éch. 17/01/2033	5 000	5 313	0,16
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				3,912 % éch. 31/01/2030	3 664	3 937	0,12	4,183 % éch. 15/05/2034	5 800	6 192	0,18
5,855 % éch. 25/11/2035	3 349	3 260	0,10	4,212 % éch. 20/10/2028	36	39	0,00	EMC Mortgage Loan Trust			
6,020 % éch. 25/01/2036	600	559	0,02	Carlyle Euro CLO DAC				5,890 % éch. 25/05/2040	\$ 108	104	0,00
6,170 % éch. 25/09/2034	1 271	1 233	0,04	3,877 % éch. 15/01/2031	6 471	6 912	0,21	Euro-Galaxy CLO DAC			
AMMC CLO Ltd.				3,953 % éch. 15/08/2030	1 449	1 545	0,05	3,831 % éch. 24/04/2034	€ 3 800	4 037	0,12
6,549 % éch. 02/11/2030	2 332	2 323	0,07	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				Fieldstone Mortgage Investment Trust			
Amortizing Residential Collateral Trust				4,137 % éch. 16/01/2033	5 600	5 921	0,18	5,458 % éch. 25/11/2036	\$ 1 150	669	0,02
5,850 % éch. 25/10/2031	22	21	0,00	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				5,818 % éch. 25/04/2047	3 908	2 758	0,08
Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				4,073 % éch. 15/11/2031	11 100	11 882	0,35	First Franklin Mortgage Loan Trust			
6,090 % éch. 25/06/2029	6	5	0,00	Carrington Mortgage Loan Trust				5,430 % éch. 25/12/2036	1 139	484	0,01
Aqueduct European CLO DAC				5,310 % éch. 25/10/2036	2 835	2 730	0,08				
3,840 % éch. 20/07/2030	€ 2 304	2 481	0,07								
Ares European CLO DAC											
4,050 % éch. 20/04/2032	€ 2 900	\$ 3 105	0,09								

Tableau des investissements Fonds Dynamic 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
5,870 % éch. 25/11/2035	\$ 1 290	\$ 1 188	0,04	Massachusetts Educational Financing Authority				3,825 % éch. 18/04/2030	€ 1 590	\$ 1 712	0,05
6,050 % éch. 25/07/2035	1 916	1 875	0,06	6,205 % éch. 25/04/2038	\$ 434	\$ 434	0,01	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
First NLC Trust				MASTR Specialized Loan Trust				6,095 % éch. 25/06/2035	\$ 399	395	0,01
5,330 % éch. 25/08/2037	6 912	3 544	0,11	5,500 % éch. 25/05/2037	74	67	0,00	6,470 % éch. 25/01/2036 ^	1 700	1 547	0,05
Fremont Home Loan Trust				5,520 % éch. 25/01/2037	1 211	492	0,01	People's Choice Home Loan Securities Trust			
5,280 % éch. 25/11/2036	1 876	681	0,02	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				6,095 % éch. 25/06/2035 ^	2 711	2 435	0,07
5,285 % éch. 25/10/2036	3 444	3 034	0,09	5,410 % éch. 25/03/2037	2 365	2 069	0,06	6,500 % éch. 25/01/2035	414	393	0,01
5,350 % éch. 25/08/2036	617	207	0,01	5,470 % éch. 25/03/2037	833	731	0,02	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
5,430 % éch. 25/02/2037	7 396	5 699	0,17	5,490 % éch. 25/07/2037	57	25	0,00	5,360 % éch. 25/01/2037	874	842	0,03
5,490 % éch. 25/02/2037	1 679	577	0,02	5,584 % éch. 25/04/2037	1 414	698	0,02	RAAC Trust			
5,650 % éch. 25/05/2036	1 299	768	0,02	5,630 % éch. 25/08/2037	11 798	6 167	0,18	5,750 % éch. 25/06/2044	121	100	0,00
5,765 % éch. 25/11/2035	6 788	5 841	0,17	5,670 % éch. 25/05/2037	1 065	620	0,02	5,910 % éch. 25/10/2046	1 369	1 297	0,04
5,885 % éch. 25/07/2035	21	21	0,00	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				6,005 % éch. 25/03/2037	28	28	0,00
6,020 % éch. 25/05/2034	1 514	1 400	0,04	5,210 % éch. 25/12/2036	1 133	563	0,02	6,350 % éch. 25/10/2045	154	150	0,00
Gallatin CLO Ltd.				5,280 % éch. 25/10/2036	666	589	0,02	Red & Black Auto Germany			
6,311 % éch. 21/01/2028	1 436	1 435	0,04	5,290 % éch. 25/10/2036	27	12	0,00	3,888 % éch. 15/09/2031	€ 2 023	2 214	0,07
GE-WMC Mortgage Securities Trust				5,290 % éch. 25/11/2036	720	341	0,01	Regatta Funding Ltd.			
5,450 % éch. 25/08/2036	10 252	4 487	0,13	5,290 % éch. 25/05/2037	2 954	2 571	0,08	6,330 % éch. 17/07/2031	\$ 1 000	991	0,03
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				5,300 % éch. 25/10/2036	6 625	3 499	0,10	Renaissance Home Equity Loan Trust			
4,100 % éch. 20/01/2032	€ 2 900	3 085	0,09	5,300 % éch. 25/11/2036	1 082	596	0,02	3,269 % éch. 25/09/2037	708	495	0,01
4,220 % éch. 20/07/2034	3 000	3 185	0,09	5,300 % éch. 25/12/2036	232	115	0,00	5,612 % éch. 25/04/2037	3 152	897	0,03
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				5,330 % éch. 25/03/2037	1 071	473	0,01	5,850 % éch. 25/08/2032	10	9	0,00
6,373 % éch. 15/09/2037	\$ 4 146	4 091	0,12	5,370 % éch. 25/10/2036	1 071	466	0,01	Residential Asset Mortgage Products Trust			
GSAA Home Equity Trust				5,380 % éch. 25/10/2036	3 917	2 075	0,06	5,890 % éch. 25/05/2037	2 562	2 241	0,07
5,270 % éch. 25/05/2036	643	161	0,01	5,400 % éch. 25/07/2036	740	638	0,02	Residential Asset Securities Corp. Trust			
5,290 % éch. 25/03/2036	2 599	988	0,03	5,400 % éch. 25/03/2037	536	237	0,01	5,490 % éch. 25/11/2036	1 914	1 793	0,05
5,750 % éch. 25/05/2047	112	75	0,00	5,450 % éch. 25/07/2036	14	12	0,00	5,490 % éch. 25/04/2037	2 662	2 475	0,07
5,985 % éch. 25/06/2036	6 344	1 754	0,05	5,450 % éch. 25/09/2036	66	25	0,00	5,670 % éch. 25/07/2036 ^	885	783	0,02
6,050 % éch. 25/08/2037	86	83	0,00	5,930 % éch. 25/01/2035	1 083	1 045	0,03	5,690 % éch. 25/07/2036	1 249	1 074	0,03
6,502 % éch. 25/11/2036	43	17	0,00	6,200 % éch. 25/09/2033	63	62	0,00	Saxon Asset Securities Trust			
GSAMP Trust				6,400 % éch. 25/07/2037	2 100	1 760	0,05	5,490 % éch. 25/10/2046	255	247	0,01
5,220 % éch. 25/12/2036	331	162	0,01	Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				Sculptor European CLO DAC			
5,350 % éch. 25/11/2036	2 848	1 380	0,04	5,510 % éch. 25/03/2036	1 085	876	0,03	3,916 % éch. 14/01/2032	€ 6 100	6 538	0,19
5,470 % éch. 25/04/2036	35	22	0,00	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5,670 % éch. 25/06/2036	2 370	2 269	0,07	5,450 % éch. 25/07/2036	1 585	646	0,02	5,470 % éch. 25/10/2036	\$ 9 702	3 377	0,10
5,690 % éch. 25/04/2036	552	347	0,01	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				5,810 % éch. 25/08/2035 ^	1 855	1 430	0,04
Harvest CLO DAC				6,465 % éch. 25/09/2046 ^	1 039	353	0,01	5,915 % éch. 25/02/2034	225	224	0,01
4,250 % éch. 26/06/2030	€ 11 521	12 316	0,37	Navient Student Loan Trust				6,110 % éch. 25/01/2036 ^	239	209	0,01
Home Equity Asset Trust				6,200 % éch. 27/12/2066	3 713	3 678	0,11	SG Mortgage Securities Trust			
6,140 % éch. 25/01/2035	\$ 3	3	0,00	New Century Home Equity Loan Trust				5,360 % éch. 25/10/2036	1 800	1 247	0,04
6,245 % éch. 25/05/2035	157	155	0,00	5,870 % éch. 25/03/2035	552	531	0,02	Sierra Madre Funding Ltd.			
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				Newcastle Investment Trust				5,571 % éch. 07/09/2039	1 933	1 385	0,04
5,310 % éch. 25/07/2037	786	421	0,01	0,000 % éch. 01/05/2033	1 249	1 218	0,04	5,591 % éch. 07/09/2039	11 090	7 959	0,24
5,370 % éch. 25/04/2037	892	666	0,02	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				Soundview Home Loan Trust			
5,390 % éch. 25/04/2037	895	584	0,02	5,300 % éch. 25/07/2036	1 831	1 724	0,05	5,230 % éch. 25/06/2037	585	394	0,01
HSI Asset Securitization Corp. Trust				5,810 % éch. 25/10/2036 ^	2 154	487	0,01	5,270 % éch. 25/11/2036	268	78	0,00
5,340 % éch. 25/01/2037	860	595	0,02	5,950 % éch. 25/02/2037 ^	582	173	0,01	5,320 % éch. 25/07/2037	781	642	0,02
5,370 % éch. 25/12/2036	4 254	1 155	0,03	6,035 % éch. 25/09/2035	98	95	0,00	5,320 % éch. 25/08/2037	2 161	1 830	0,05
5,590 % éch. 25/12/2036	3 862	1 043	0,03	NovaStar Mortgage Funding Trust				5,360 % éch. 25/06/2037	2 710	1 825	0,05
5,675 % éch. 25/02/2036	7 100	6 055	0,18	5,310 % éch. 25/09/2037	604	597	0,02	5,430 % éch. 25/06/2037	3 905	2 630	0,08
5,930 % éch. 25/01/2036	9 668	7 567	0,22	5,350 % éch. 25/09/2037	628	609	0,02	5,710 % éch. 25/10/2036	375	363	0,01
IXIS Real Estate Capital Trust				5,490 % éch. 25/11/2036	2 153	673	0,02	6,050 % éch. 25/10/2037	4 992	3 940	0,12
5,610 % éch. 25/01/2037	272	99	0,00	5,570 % éch. 25/01/2037	1 393	488	0,01	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				7,025 % éch. 25/03/2035	846	830	0,02	3,597 % éch. 25/09/2037	473	160	0,01
4,459 % éch. 25/01/2037 ^	837	458	0,01	OCP Euro CLO DAC				3,700 % éch. 25/02/2037 ^	1 504	587	0,02
5,410 % éch. 25/06/2037	56	55	0,00	3,997 % éch. 15/01/2032	€ 3 948	4 252	0,13	4,460 % éch. 25/12/2036	999	936	0,03
5,450 % éch. 25/07/2036	647	290	0,01	4,091 % éch. 22/09/2034	6 800	7 226	0,21	St. Paul's CLO DAC			
5,555 % éch. 25/07/2036	2 467	2 390	0,07	4,713 % éch. 20/01/2033	10 000	10 893	0,32	3,927 % éch. 15/01/2032	€ 1 294	1 388	0,04
Jubilee CLO DAC				Octagon Investment Partners Ltd.				Structured Asset Investment Loan Trust			
3,827 % éch. 15/04/2031	€ 3 100	3 298	0,10	6,230 % éch. 15/04/2031	\$ 850	844	0,03	6,125 % éch. 25/01/2035	\$ 4 321	3 866	0,12
LCM LP				Option One Mortgage Loan Trust				6,275 % éch. 25/01/2035	418	347	0,01
6,290 % éch. 20/10/2027	\$ 138	138	0,00	5,290 % éch. 25/02/2037	842	549	0,02	6,725 % éch. 25/01/2035	456	341	0,01
Lehman XS Trust				5,290 % éch. 25/03/2037	146	131	0,00	6,875 % éch. 25/01/2035 ^	321	130	0,00
4,284 % éch. 25/06/2036	754	707	0,02	5,370 % éch. 25/04/2037	4 599	3 274	0,10	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,470 % éch. 25/05/2036	1 872	1 613	0,05	5,370 % éch. 25/05/2037	3 711	2 189	0,07	5,305 % éch. 25/09/2036	7 280	4 577	0,14
Long Beach Mortgage Loan Trust				5,885 % éch. 25/08/2035	38	37	0,00	5,330 % éch. 25/01/2037	849	510	0,02
5,370 % éch. 25/11/2036	9 357	2 973	0,09	Owinit Mortgage Loan Trust				5,650 % éch. 25/11/2037	2 123	1 946	0,06
5,590 % éch. 25/02/2036	1 670	1 617	0,05	5,438 % éch. 25/05/2037	636	483	0,01	6,155 % éch. 25/11/2035	6 700	6 583	0,20
5,750 % éch. 25/02/2036	263	216	0,01	OZLM Ltd.				6,670 % éch. 25/04/2035	53	52	0,00
5,795 % éch. 25/11/2035	449	445	0,01	6,348 % éch. 16/05/2030	3 406	3 382	0,10	Structured Asset Securities Corp. Trust			
6,065 % éch. 25/08/2035	700	618	0,02	OZLME DAC				5,840 % éch. 25/09/2035	4 099	3 880	0,12
Madison Park Euro Funding DAC				4,162 % éch. 24/08/2030	€ 2 924	3 128	0,09	Symphony CLO Ltd.			
3,927 % éch. 15/01/2032	€ 9 800	10 468	0,31	Palmer Square European Loan Funding DAC				6,140 % éch. 15/04/2028	271	270	0,01
Madison Park Funding Ltd.				3,907 % éch. 15/07/2031	8 592	9 154	0,27	Tikehau CLO DAC			
6,010 % éch. 15/04/2029	\$ 3 800	3 759	0,11	3,957 % éch. 15/04/2031	4 714	5 053	0,15	4,144 % éch. 04/08/2034	€ 500	533	0,02
Man GLG Euro CLO DAC				5,025 % éch. 12/04/2032	9 262	10 159	0,30				
4,047 % éch. 15/01/2030	€ 308	332	0,01	Palmerston Park CLO DAC							
4,216 % éch. 15/12/2031	3 497	3 746	0,11								

Tableau des investissements Fonds Dynamic 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 Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	925	\$ 1 704	0,05
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	614	806	0,03
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	1 140	1 055	0,03
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	2 230	(6 300)	(0,19)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	4 343	(8 652)	(0,26)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	4 710	8 302	0,25
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	919	768	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Court	09/2023	536	(56)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	877	(1 710)	(0,05)
				\$ (4 083)	(0,12)

OPTIONS VENDUES

OPTIONS 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 - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	\$ 98,000	15/12/2023	4	\$ (3)	\$ 0	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	4	(4)	(19)	0,00
				\$ (7)	\$ (19)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					\$ (4 102)	(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 ⁽³⁾	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AES Corp.	5,000 %	20/12/2025	\$ 500	\$ (47)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	5 300	39	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	2 700	(30)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	300	2	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2026	100	2	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2024	€ 7 000	47	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	\$ 4 300	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	400	0	0,00
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	€ 4 300	23	0,00
				\$ 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.EM-33 à 5 ans	(1,000) %	20/06/2025	\$ 87	\$ (5)	0,00
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	(5,000)	20/06/2028	45 800	(1 070)	(0,03)
				\$ (1 075)	(0,03)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION⁽⁴⁾

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 à 5 ans	1,000 %	20/12/2025	\$ 200	\$ (1)	0,00
Indice CDX.IG-36 à 5 ans	1,000	20/06/2026	700	(7)	0,00
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	3 300	23	0,00
Indice iTraxx Crossover 39 à 5 ans	5,000	20/06/2028	€ 15 400	530	0,01
				\$ 545	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 ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500 %	20/09/2033	£ 93 300	\$ (5 114)	(0,15)
À recevoir ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	80 100	5 110	0,15
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/08/2023	\$ 345 100	4 761	0,14
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	20/09/2023	104 830	(1 465)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,270	04/11/2023	345 100	(6 839)	(0,20)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	21/12/2052	24 100	1 788	0,05
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,827	03/07/2028	85 800	(7 981)	(0,23)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,857	15/07/2032	29 520	(4 158)	(0,12)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,999	03/07/2053	17 500	3 896	0,12
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	10/12/2029	40	5	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,250	20/06/2028	104 830	2 496	0,07
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	31 200	78	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,080	23/02/2053	2 500	(46)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,370	01/03/2033	3 500	(59)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,405	01/03/2033	3 700	(52)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,425	01/03/2033	3 600	(46)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,430	27/02/2033	8 400	(104)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,450	07/03/2033	7 300	(79)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	9 600	(161)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	7 400	(61)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	10,206	04/01/2027	BRL 13 900	(63)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,045	04/01/2027	136 700	161	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,050	04/01/2027	126 600	154	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,086	04/01/2027	82 400	100	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,098	04/01/2027	126 200	163	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,115	04/01/2027	271 000	2 201	0,07
À payer	CDI BRL à 1 an	11,460	04/01/2027	145 000	641	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,734	02/01/2025	127 000	(15)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,800	02/01/2025	128 000	16	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,814	04/01/2027	76 300	447	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,835	02/01/2025	129 000	33	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,868	04/01/2027	68 000	420	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	12,500	04/01/2027	185 800	1 850	0,05
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,000	14/11/2023	CAD 54 100	(664)	(0,02)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,060	28/10/2023	516 600	(4 000)	(0,12)
À payer	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	4,000	21/06/2025	387 200	(2 812)	(0,08)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	01/11/2023	NZD 144 800	(1 242)	(0,04)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	15/12/2023	203 200	(1 699)	(0,05)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/08/2023	\$ 345 100	(4 734)	(0,14)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	20/09/2023	104 830	1 475	0,04
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	10/09/2023	40	0	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	€ 6 700	(712)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	5 800	(604)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	3 400	(356)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	7 200	(675)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	3 500	(328)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	8 800	(131)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	9 000	(135)	0,00
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	40 700	366	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,160	16/09/2027	PLN 93 100	(1 562)	(0,05)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,210	26/04/2027	116 600	(1 061)	(0,03)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,240	23/09/2027	78 600	(1 399)	(0,04)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,250	23/09/2027	55 300	(990)	(0,03)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,270	20/09/2027	89 800	(1 621)	(0,05)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,280	26/09/2027	26 700	(490)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,310	19/09/2027	94 800	(1 757)	(0,05)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,985	11/10/2027	113 000	(2 969)	(0,09)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,156	13/10/2027	58 300	(1 643)	(0,05)
					\$ (31 666)	(0,93)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (32 157)	(0,95)

- (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.

Tableau des investissements Fonds Dynamic 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

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 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021 %	25/10/2023	7 600	\$ 434	\$ 1 926	0,06
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021	15/09/2023	12 200	640	2 939	0,09
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021	15/09/2023	12 800	696	3 187	0,09
							\$ 1 770	\$ 8 052	0,24

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 de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020 %	25/10/2023	38 000	\$ (435)	\$ (3 420)	(0,10)
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	15/09/2023	61 000	(640)	(5 666)	(0,17)
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	3 700	(24)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	3 700	(24)	(75)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	3 700	(26)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	3 700	(26)	(71)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	3 700	(26)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	3 700	(26)	(69)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	3 700	(26)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	3 700	(26)	(68)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	3 700	(25)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	3 700	(25)	(77)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	3 700	(25)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	3 700	(25)	(81)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	10 800	(34)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	10 800	(34)	(135)	(0,01)
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,250	20/07/2023	6 400	(22)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	6 400	(22)	(26)	0,00
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	15/09/2023	64 000	(697)	(6 032)	(0,18)
							\$ (2 188)	\$ (15 732)	(0,47)

⁽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 %	20/12/2023	\$ 2 100	\$ (154)	\$ 145	\$ (9)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	200	(14)	13	(1)	0,00
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)	688	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	300	(37)	31	(6)	0,00
HUS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2023	200	(6)	7	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2024	1 100	(32)	40	8	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	200	(12)	12	0	0,00
MYC	Obligations California State General Obligation Bonds, Series 2003	1,000	20/09/2024	2 900	23	9	32	0,00
					\$ (926)	\$ 957	\$ 31	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	\$ 800	\$ (24)	\$ 21	\$ (3)	0,00
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	11 000	(379)	334	(45)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	10 900	(378)	334	(44)	0,00
					\$ (781)	\$ 689	\$ (92)	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	07/2023	AUD 3 106	\$ 2 061	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
	07/2023	\$ 380	AUD 581	6	0	6	0,00
	08/2023	2 063	3 106	6	0	6	0,00
BOA	07/2023	¥ 330 100	\$ 2 344	60	0	60	0,00
	07/2023	MXN 75 161	4 083	0	(289)	(289)	(0,01)
	07/2023	PLN 19 596	4 700	0	(120)	(120)	0,00
	07/2023	\$ 3 054	AUD 4 677	59	0	59	0,00
	07/2023	142	DKK 964	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	2 924	£ 2 317	22	0	22	0,00
	07/2023	406	PEN 1 489	4	0	4	0,00
	07/2023	3 800	PLN 15 765	77	0	77	0,00
	08/2023	DKK 962	\$ 142	1	0	1	0,00
	08/2023	NZD 756	479	16	0	16	0,00
	08/2023	\$ 490	CNY 3 364	0	(25)	(25)	0,00
	08/2023	808	ZAR 14 777	0	(29)	(29)	0,00
	08/2023	ZAR 1 949	\$ 101	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	HKD 6 434	823	1	0	1	0,00
	09/2023	KRW 71 850	57	2	0	2	0,00
	09/2023	TWD 1 292	43	1	0	1	0,00
	09/2023	\$ 8 467	INR 700 307	46	0	46	0,00
BPS	07/2023	AUD 2 220	\$ 1 471	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	DKK 535	77	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	£ 177	219	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	PLN 6 174	1 497	0	(21)	(21)	0,00
	07/2023	\$ 88	BRL 425	0	0	0	0,00
	07/2023	4 133	€ 3 783	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	1 130	£ 882	0	(9)	(9)	0,00
	07/2023	52 799	¥ 7 339 012	0	(2 023)	(2 023)	(0,06)
	07/2023	266	PLN 1 100	5	0	5	0,00
	08/2023	BRL 425	\$ 87	0	0	0	0,00
	08/2023	CNH 2 554	370	17	0	17	0,00
	08/2023	TWD 647	21	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 1 472	AUD 2 220	7	0	7	0,00
	08/2023	579	CNY 3 956	0	(31)	(31)	0,00
	08/2023	242	ZAR 4 512	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023	ZAR 32 267	\$ 1 758	57	0	57	0,00
	09/2023	\$ 177	PEN 648	1	0	1	0,00
	10/2023	ZAR 264 036	\$ 14 186	356	0	356	0,01
BRC	07/2023	PLN 5 604	1 342	0	(36)	(36)	0,00
	08/2023	\$ 2 436	COP 10 375 848	19	0	19	0,00
	08/2023	295	ZAR 5 460	0	(8)	(8)	0,00
	09/2023	62	ILS 221	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	164	PEN 600	1	0	1	0,00
BSH	07/2023	1 315	4 838	20	0	20	0,00
CBK	07/2023	CAD 3 496	\$ 2 565	0	(76)	(76)	0,00
	07/2023	CLP 6 717 507	8 300	0	(65)	(65)	0,00
	07/2023	PEN 9 420	2 594	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	\$ 1 317	AUD 2 019	27	0	27	0,00
	07/2023	8 776	€ 8 100	64	(3)	61	0,00
	07/2023	4 380	PEN 16 175	81	0	81	0,00
	07/2023	931	PLN 3 833	11	0	11	0,00
	08/2023	PEN 10 169	\$ 2 603	0	(192)	(192)	(0,01)
	08/2023	TWD 623	20	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 8 329	CLP 6 814 398	105	0	105	0,00
CLY	07/2023	DKK 1 558	\$ 225	0	(3)	(3)	0,00
DUB	07/2023	PEN 9 420	2 576	0	(23)	(23)	0,00
	07/2023	\$ 24 689	BRL 133 775	3 043	0	3 043	0,09
	07/2023	5 168	PEN 18 841	28	0	28	0,00
	09/2023	9	34	0	0	0	0,00
GLM	07/2023	BRL 134 200	\$ 27 793	0	(26)	(26)	0,00
	07/2023	\$ 18 415	MXN 323 929	440	0	440	0,01
	07/2023	1 175	PLN 4 929	37	0	37	0,00
	09/2023	27 793	BRL 135 687	22	0	22	0,00
	10/2023	ZAR 27 186	\$ 1 449	25	0	25	0,00
JPM	07/2023	¥ 2 386 857	16 690	176	0	176	0,01
	07/2023	\$ 2 937	AUD 4 493	53	0	53	0,00
	07/2023	659 427	€ 603 926	0	(543)	(543)	(0,02)
	07/2023	474	PLN 2 010	20	0	20	0,00
	08/2023	CNH 2 050	\$ 297	14	0	14	0,00
	08/2023	€ 603 926	660 349	563	0	563	0,02
	08/2023	HUF 24 175	69	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$ 610	CNY 4 173	0	(33)	(33)	0,00
	08/2023	757	HUF 260 912	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023	16 690	¥ 2 376 714	0	(177)	(177)	(0,01)
	08/2023	1 777	ZAR 32 513	0	(62)	(62)	0,00
	08/2023	ZAR 87	\$ 5	0	0	0	0,00
	09/2023	PEN 42 510	11 545	0	(112)	(112)	0,00
	09/2023	\$ 60	ILS 212	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	624	INR 51 438	1	0	1	0,00
	09/2023	2 680	PEN 9 788	4	0	4	0,00
	10/2023	8 427	MXN 147 958	34	0	34	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		
MBC	07/2023	CAD	\$	3 427	2 569	\$ 0	\$ (21)	\$ (21)	0,00
	07/2023	€		1 916	2 049	0	(41)	(41)	0,00
	07/2023	£		144 165	178 456	0	(4 828)	(4 828)	(0,14)
	07/2023	\$	€	2 592	2 416	44	0	44	0,00
	07/2023		£	1 027	824	21	0	21	0,00
	07/2023		PLN	93	403	6	0	6	0,00
	08/2023	HUF	\$	828 406	2 428	35	0	35	0,00
	09/2023	KRW		133 187	104	3	0	3	0,00
	07/2023	£		508	640	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	\$	DKK	126	859	0	0	0	0,00
MYI	07/2023		€	8	7	0	0	0	0,00
	07/2023		£	1 233	977	9	0	9	0,00
	07/2023		PLN	1 035	4 367	39	0	39	0,00
	08/2023	DKK	\$	858	126	0	0	0	0,00
	08/2023	TWD		696	23	1	0	1	0,00
	09/2023	KRW		149 681	117	3	0	3	0,00
	09/2023	\$	INR	135	11 110	0	0	0	0,00
	07/2023		£	5 034	3 938	0	(27)	(27)	0,00
	07/2023		MXN	5	90	1	0	1	0,00
	08/2023	MXN	\$	76 881	4 436	0	(10)	(10)	0,00
RYL	07/2023	\$	33	138	1	0	1	0,00	
	07/2023	AUD	\$	4 562	3 028	0	(8)	(8)	0,00
SCX	07/2023	\$	4 144	6 342	77	0	77	0,00	
	08/2023	CNH	\$	972	141	7	0	7	0,00
	08/2023	NZD		268	168	3	0	3	0,00
	08/2023	\$	AUD	3 031	4 562	8	0	8	0,00
	08/2023		CNH	795	5 455	0	(42)	(42)	0,00
	08/2023		CNY	1 623	11 080	0	(90)	(90)	0,00
	09/2023	TWD	\$	1 080	35	1	0	1	0,00
	09/2023	\$	INR	391	32 170	0	0	0	0,00
	09/2023		PEN	975	3 591	10	0	10	0,00
	07/2023	€	\$	616 171	662 839	0	(9 404)	(9 404)	(0,28)
SOG	07/2023	PLN		241 184	55 985	0	(3 329)	(3 329)	(0,10)
	07/2023	\$	AUD	2 512	3 839	44	0	44	0,00
SSB	07/2023	¥	\$	23 470 000	177 970	14 951	0	14 951	0,45
	07/2023	PEN		14 259	3 909	0	(22)	(22)	0,00
	07/2023	\$	CLP	8 374	6 727 138	3	0	3	0,00
	08/2023	CLP	\$	6 746 566	8 374	1	0	1	0,00
TOR	08/2023	\$	PEN	3 904	14 259	20	0	20	0,00
	07/2023	AUD	\$	5 614	3 708	0	(29)	(29)	0,00
	07/2023	\$	AUD	1 329	2 032	24	0	24	0,00
	07/2023		CAD	5 232	6 923	4	(4)	0	0,00
	07/2023		£	173 299	136 381	89	0	89	0,00
	08/2023	CAD	\$	6 920	5 232	4	(4)	0	0,00
	08/2023	£		136 381	173 337	0	(86)	(86)	0,00
	08/2023	HUF		15 313	44	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$	AUD	3 711	5 614	29	0	29	0,00
	07/2023	AUD	\$	8 947	5 974	31	(12)	19	0,00
UAG	07/2023	€		138	148	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$	AUD	304	465	5	0	5	0,00
	08/2023			5 979	8 947	12	(31)	(19)	0,00
	08/2023	ZAR	\$	678 817	35 349	10	(441)	(431)	(0,01)
	09/2023	SGD		23 771	17 786	171	0	171	0,01
	09/2023	\$	ILS	51	184	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023		INR	8 014	662 512	39	0	39	0,00
						\$ 21 238	\$ (22 391)	\$ (1 153)	(0,04)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	\$	1 179	782	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07/2023	\$	AUD	1 499	2 291	26	0	26	0,00
	08/2023			783	1 179	2	0	2	0,00
BOA	07/2023	AUD	\$	237	158	1	0	1	0,00
	07/2023	\$	AUD	3 075	4 727	72	0	72	0,01
BPS	07/2023	AUD	\$	6 229	4 127	1	(20)	(19)	0,00
	08/2023	\$	AUD	3 962	5 976	20	0	20	0,00
CBK	07/2023	AUD	\$	24	16	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	AUD	1 028	1 574	20	0	20	0,00
JPM	07/2023			1 533	2 345	28	0	28	0,00
MBC	07/2023	AUD	\$	246	164	0	0	0	0,00
RBC	07/2023			101	68	1	0	1	0,00
	07/2023			2 212	1 469	1	(4)	(3)	0,00
SCX	07/2023	\$	AUD	1 222	1 870	23	0	23	0,00
	08/2023			1 382	2 079	4	0	4	0,00
SOG	07/2023			2 439	3 728	42	0	42	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
TOR	07/2023	AUD 3 631	\$ 2 398	\$ 0	\$ (19)	\$ (19)	0,00
	07/2023	\$ 2 592	AUD 3 963	46	0	46	0,00
	08/2023	2 400	3 631	19	0	19	0,00
UAG	07/2023	AUD 7 503	\$ 4 989	15	(20)	(5)	0,00
	07/2023	\$ 1 200	AUD 1 833	20	0	20	0,00
	08/2023	4 599	6 921	20	(9)	11	0,00
				\$ 361	\$ (74)	\$ 287	0,01

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 2 804	CAD 3 815	\$ 79	\$ 0	\$ 79	0,01
CBK	07/2023	47	64	1	0	1	0,00
JPM	07/2023	2 811	3 814	71	0	71	0,00
MBC	07/2023	CAD 24	\$ 18	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	\$ 2 811	CAD 3 818	74	0	74	0,00
				\$ 225	\$ 0	\$ 225	0,01

Au 30 juin 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	07/2023	CHF 20 207	\$ 22 594	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
	07/2023	\$ 34 628	CHF 31 324	385	0	385	0,01
	08/2023	22 594	20 149	0	(8)	(8)	0,00
CLY	07/2023	CHF 10 680	\$ 11 890	0	(48)	(48)	0,00
	08/2023	\$ 11 890	CHF 10 650	48	0	48	0,00
MBC	07/2023	CHF 9 238	\$ 10 304	0	(22)	(22)	0,00
MYI	07/2023	2 713	3 035	3	0	3	0,00
	07/2023	\$ 104	CHF 94	1	0	1	0,00
SCX	07/2023	25 909	23 280	112	0	112	0,01
UAG	07/2023	CHF 20 861	\$ 23 271	0	(46)	(46)	0,00
	07/2023	\$ 23 294	CHF 20 931	102	0	102	0,00
	08/2023	23 252	20 784	46	0	46	0,00
				\$ 705	\$ (124)	\$ 581	0,02

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 368	\$ 399	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	07/2023	\$ 83 445	€ 77 645	1 265	0	1 265	0,04
BPS	07/2023	€ 64 459	\$ 70 625	302	(1)	301	0,01
	07/2023	\$ 83 342	€ 77 527	1 240	0	1 240	0,04
	08/2023	69 680	63 505	0	(301)	(301)	(0,01)
CBK	07/2023	€ 68 333	\$ 74 268	3	(287)	(284)	(0,01)
	07/2023	\$ 700	€ 652	12	0	12	0,00
	08/2023	68 962	63 341	238	0	238	0,01
JPM	07/2023	€ 63 368	\$ 69 192	57	0	57	0,00
	08/2023	\$ 69 288	€ 63 368	0	(59)	(59)	0,00
MBC	07/2023	€ 36 882	\$ 40 304	103	(38)	65	0,00
	07/2023	\$ 49	€ 46	1	0	1	0,00
SOG	07/2023	83 399	77 527	1 183	0	1 183	0,03
				\$ 4 404	\$ (689)	\$ 3 715	0,11

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 1 188	£ 942	\$ 10	\$ 0	\$ 10	0,00
BPS	07/2023	832 907	673 387	23 205	(1)	23 204	0,69
BRC	07/2023	£ 53 910	\$ 67 251	0	(1 287)	(1 287)	(0,04)
	07/2023	\$ 1 659	£ 1 322	22	(1)	21	0,00
CBK	07/2023	£ 453	\$ 577	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 1 956	£ 1 549	14	0	14	0,00
JPM	07/2023	£ 654 483	\$ 827 528	0	(4 549)	(4 549)	(0,14)
	08/2023	\$ 827 704	£ 654 483	4 540	0	4 540	0,13
MBC	07/2023	831 823	671 949	22 463	(4)	22 459	0,67
MYI	07/2023	832 450	669 785	19 082	0	19 082	0,57
TOR	07/2023	£ 656 585	\$ 834 323	0	(427)	(427)	(0,01)
	08/2023	\$ 834 505	£ 656 585	412	0	412	0,01
				\$ 69 749	\$ (6 269)	\$ 63 480	1,88

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

Au 30 juin 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	07/2023	NOK 9	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 113	NOK 1 243	3	0	3	0,00
BPS	07/2023	NOK 879	\$ 82	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 82	NOK 878	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	101	1 138	5	0	5	0,00
GLM	07/2023	NOK 930	\$ 86	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$ 86	NOK 929	1	0	1	0,00
UAG	07/2023	90	999	3	0	3	0,00
				\$ 12	\$ (1)	\$ 11	0,00

Au 30 juin 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	07/2023	SEK 19 648	\$ 1 821	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	07/2023	\$ 16	SEK 173	0	0	0	0,00
	08/2023	1 808	19 483	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07/2023	SEK 125	\$ 12	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	\$ 1 190	SEK 13 001	13	0	13	0,00
GLM	07/2023	SEK 25	\$ 2	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	18	2	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 1 237	SEK 13 320	0	(4)	(4)	0,00
MYI	07/2023	SEK 19 516	\$ 1 808	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 1 777	SEK 19 076	0	(11)	(11)	0,00
	08/2023	1 808	19 492	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2023	SEK 80	\$ 7	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 1 237	SEK 13 381	2	0	2	0,00
				\$ 18	\$ (17)	\$ 1	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 59 406 1,76

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. 01/07/2053	\$ 96 900	\$ (79 045)	(2,35)
2,000 % éch. 01/08/2053	4 000	(3 268)	(0,09)
Total des titres vendus à découvert		\$ (82 313)	(2,44)
Total des Investissements		\$ 3 844 962	114,19
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (477 669)	(14,19)
Actifs nets		\$ 3 367 293	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) 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 : 0,24 %) :

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	\$ 112	\$ 112	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. « D » - Exp. 10 juin 2071	10/06/2022	0	0	0,00
Deutsche Bank AG 0,898 % éch. 28/05/2024	25/05/2021	1 900	1 806	0,05
Deutsche Bank AG 3,035 % éch. 28/05/2032	25/05/2021	800	631	0,02
Intelsat Emergence S.A.	05/09/2018	2 000	444	0,01
Morgan Stanley 0,000 % éch. 02/04/2032	29/07/2022	2 458	2 250	0,07
		\$ 7 270	\$ 5 243	0,15

(k) Un titre d'une juste valeur globale de 213 \$ (31 décembre 2022 : 2 041 \$) 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 30 juin 2023.

(l) Des titres d'une juste valeur globale de 3 486 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 14 370 \$ (31 décembre 2022 : 48 797 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 55 345 \$ (31 décembre 2022 : 45 907 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 601	\$ 3 006 528	\$ 4 391	\$ 3 011 520
Fonds d'investissement	336 750	0	0	336 750
Contrats de mise en pension	0	555 858	0	555 858
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	3 565	19 582	0	23 147
Titres vendus à découvert	0	(82 313)	0	(82 313)
Totaux	\$ 340 916	\$ 3 499 655	\$ 4 391	\$ 3 844 962

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 30 juin 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	0,000 %	21/06/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (199)	\$ (217)	(0,01)
Total des contrats de prise en pension					\$ (217)	(0,01)

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ (30)	\$ 2	\$ 36	\$ 0	\$ 36
BOA	(252)	0	(252)	(3 100)	3 170	70
BPS	23 165	(16 310)	6 855	(3 900)	3 880	(20)
BRC	(1 293)	806	(487)	(359)	320	(39)
BSH	20	0	20	S/O	S/O	S/O
CBK	(32)	0	(32)	4 410	(4 530)	(120)
CLY	(3)	0	(3)	(250)	0	(250)
DUB	3 048	(2 920)	128	24	(100)	(76)
FAR	(2 727)	2 640	(87)	(1 982)	1 690	(292)
GLM	(82)	0	(82)	(17 283)	17 179	(104)

Contrepartie	Au 30 juin 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⁾
GST	\$ (4)	\$ 0	\$ (4)	\$ (48)	\$ 208	\$ 160
HUS	9	0	9	S/O	S/O	S/O
JPM	(14)	0	(14)	(2 303)	310	(1 993)
MBC	17 718	(12 860)	4 858	2 683	(3 440)	(757)
MYC	(2 858)	2 780	(78)	(2 059)	1 970	(89)
MYI	19 122	(12 730)	6 392	1 202	(910)	292
RBC	(35)	0	(35)	(86)	60	(26)
RYL	1	0	1	(76)	0	(76)
SAL	S/O	S/O	S/O	(40)	0	(40)
SCX	178	(100)	78	(8 642)	8 280	(362)
SOG	(11 464)	8 950	(2 514)	S/O	S/O	S/O
SSB	14 953	(15 240)	(287)	(2 124)	1 540	(584)
TOR	57	0	57	(12 777)	9 630	(3 147)
UAG	(133)	2 680	2 547	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	42,13	30,35
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	47,29	46,36
Autres valeurs mobilières	0,01	1,16
Fonds d'investissement	10,00	10,00
Contrats de mise en pension	16,51	32,89
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,12)	0,08
Instruments financiers dérivés compensés	(0,95)	(1,19)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,76	(1,36)
Titres vendus à découvert	(2,44)	(2,36)
Contrats de prise en pension	(0,01)	(0,06)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	1,10	1,91
Obligations et billets privés	23,48	22,11
Obligations et billets convertibles	0,26	0,40
Obligations et billets municipaux	0,27	0,35
Agences du gouvernement américain	20,48	8,36
Obligations du Trésor américain	2,72	2,61
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	8,26	8,21
Titres adossés à des actifs	17,83	18,00
Émissions souveraines	2,65	3,20
Actions ordinaires	0,09	0,05
Droits	0,00	0,00
Bons de souscription	0,00	0,00
Titres privilégiés	0,03	0,17
Instruments à court terme	12,26	12,50
Fonds d'investissement	10,00	10,00
Contrats de mise en pension	16,51	32,89
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,12)	0,08
Options vendues		
Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	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	(0,03)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,01	0,03
Swaps de taux d'intérêt	(0,93)	(1,19)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,24	0,34
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,47)	(0,95)
Options sur titres	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	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	S/O	0,02
Contrats de change à terme	(0,04)	(1,05)
Contrats de change à terme couverts	2,03	0,29
Titres vendus à découvert	(2,44)	(2,36)
Autres actifs et passifs à court terme	(14,19)	(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	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
(0,188) % éch. 18/07/2023 (b)(c)	¥ 30 000	€ 190	0,00	FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE			
(0,187) % éch. 10/07/2023 (b)(c)	9 732 000	61 718	1,45	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Income Fund (f)	6 473 317	€ 102 529	2,41	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	2 485 300	€ 241 004	5,66
(0,179) % éch. 11/09/2023 (b)(c)	2 452 000	15 553	0,36								
(0,168) % éch. 10/07/2023 (b)(c)	3 958 000	25 101	0,59	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Capital Securities Fund (f)	2 942 298	28 209	0,66	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (f)	1 532 400	15 843	0,37
(0,152) % éch. 25/09/2023 (b)(c)	11 999 000	76 116	1,79								
(0,132) % éch. 25/09/2023 (b)(c)	3 411 000	21 638	0,51	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (f)	3 189 591	32 27€	0,76				
		270 415	6,35							256 847	6,03
Total des Instruments à court terme		641 542	15,07					Total des Fonds d'investissement		€ 419 861	9,86
Total des Valeurs mobilières		€ 4 246 875	99,74								
						163 014	3,83				

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	3,100 %	30/06/2023	03/07/2023	€ 73 200	Société Nationale SNCF S.A. 4,150 % échéance 18/01/2042	€ (73 831)	€ 73 200	€ 73 219	1,72
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	\$ 17 637	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	(16 489)	16 166	16 166	0,38
IND	3,150	30/06/2023	03/07/2023	€ 28 000	Obligation internationale du gouvernement français 1,500 % - 5,500 % échéance 25/10/2023 - 25/05/2050	(28 465)	28 000	28 007	0,66
	3,150	30/06/2023	03/07/2023	212 200	Agence Française de Développement EPIC 0,000 % - 3,125 % échéance 04/01/2024 - 31/10/2034	(5 350)	212 200	212 256	4,98
					Agence France Locale 3,000 % échéance 20/03/2030	(692)			
					BNG Bank NV 0,050 % - 1,500 % échéance 20/11/2029 - 15/07/2039	(2 220)			
					Bpifrance 0,250 % échéance 04/06/2031	(798)			
					Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2,375 % - 4,000 % échéance 25/01/2024 - 15/12/2025	(1 508)			
					Banque de développement du Conseil de l'Europe 0,000 % - 1,000 % échéance 09/04/2027 - 13/04/2029	(2 300)			
					Fonds européen de stabilité financière 0,000 % - 2,750 % échéance 17/07/2023 - 10/07/2048	(20 475)			
					Banque européenne d'investissement 0,000 % - 3,625 % échéance 15/07/2024 - 16/10/2048	(29 499)			
					Mécanisme européen de stabilité 0,000 % - 1,625 % échéance 31/07/2023 - 17/11/2036	(5 212)			
					Union européenne 0,000 % - 3,375 % échéance 04/11/2025 - 04/10/2052	(30 747)			
					Bons du Trésor de l'Union européenne 0,000 % échéance 08/09/2023 - 10/11/2023	(20 536)			
					Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % - 3,125 % échéance 02/04/2024 - 15/06/2037	(32 466)			
					La Poste S.A. 2,625 % - 3,125 % échéance 14/09/2028 - 14/03/2033	(1 143)			
					Land Berlin 0,010 % échéance 26/10/2028	(3 312)			
					Landwirtschaftliche Rentenbank 0,500 % échéance 06/03/2025	(1 237)			
					Obligation internationale du gouvernement luxembourgeois 0,000 % - 3,250 % échéance 19/03/2028 - 02/03/2043	(50 663)			
					Nederlandse Waterschapsbank NV 0,000 % échéance 16/02/2037	(1 634)			
					NRW Bank 0,490 % échéance 23/02/2026	(600)			
					SFIL S.A. 1,500 % échéance 05/03/2032	(174)			
					État de Basse-Saxe 2,875 % échéance 18/04/2028	(197)			
					État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie 0,000 % - 0,625 % échéance 17/11/2023 - 26/11/2029	(2 043)			
					UNEDIC 0,000 % - 1,250 % échéance 17/02/2025 - 25/05/2036	(4 648)			
Total des contrats de mise en pension						€ (336 239)	€ 329 566	€ 329 648	7,74

(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 obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Long	09/2023	9 359	€ (4 643)	(0,11)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre	Long	09/2023	1 682	(2 074)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index septembre	Long	09/2023	3 482	9 485	0,22
Contrats à terme standardisés sur Euro STOXX 50 septembre	Court	09/2023	3 258	(2 145)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	1 453	(777)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index septembre	Long	09/2023	470	(334)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Nikkei 225 libellés en yen septembre	Long	09/2023	628	2 008	0,05
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	4 758	(8 676)	(0,20)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	1 707	1 773	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	1 724	2 072	0,05
				€ (3 311)	(0,08)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				€ (3 311)	(0,08)

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	€ (4)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	100	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2028	1 200	4	0,00
				€ 2	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-39 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	\$ 102 800	€ 262	0,01
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	1 161 300	7 673	0,18
Indice iTraxx Crossover 39 à 5 ans	5,000	20/06/2028	€ 15 100	474	0,01
				€ 8 409	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	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750 %	21/06/2053	\$ 110 400	€ (879)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2030	324 500	3 520	0,08
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	20/12/2053	30 500	(307)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2030	96 700	(132)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,250	16/06/2031	CAD 82 272	(6 476)	(0,15)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	150 600	(18 046)	(0,42)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,900	18/12/2029	181	(21)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,500	19/06/2029	123 500	(13 870)	(0,33)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	€ 17 200	(343)	(0,01)
					€ (36 554)	(0,86)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					€ (28 143)	(0,66)

⁽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.

Tableau des investissements Fonds Dynamic Multi-Asset 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 - 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
BPS	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000) %	20/12/2023	\$ 17 130	€ (303)	€ 240	€ (63)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/12/2023	16 800	(309)	247	(62)	0,00
					€ (612)	€ 487	€ (125)	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⁾ 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 payer	Indice IXITR Index	35 821	Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	\$ 136 046	21/02/2024	€ 0	€ (2 830)	€ (2 830)	(0,07)

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	07/2023	CHF	5 230	€ 5 404	€ 46	€ 0	0,00		
	07/2023	DKK	79 538	10 682	0	0	0,00		
	07/2023	€	4 505	\$ 4 935	19	0	0,00		
	07/2023	£	1 202	€ 1 403	3	0	0,00		
	07/2023	MXN	1 514 828	\$ 82 283	0	(5 300)	(0,12)		
	07/2023	\$	50 244	CLP 40 670 241	419	0	419	0,01	
	07/2023		26 619	€ 24 769	370	0	370	0,01	
	08/2023		77	CNY 532	0	(4)	(4)	0,00	
	09/2023	HKD	664 812	\$ 85 081	91	0	91	0,00	
	09/2023	KRW	29 603 067	23 365	734	0	734	0,02	
	09/2023	TWD	3 453 846	113 775	2 415	0	2 415	0,06	
	09/2023	\$	9 264	INR 761 394	0	(9)	(9)	0,00	
	BPS	07/2023	AUD	31 480	€ 19 539	339	(7)	332	0,01
		07/2023	€	17 811	AUD 29 332	84	0	84	0,00
07/2023			1 501 445	\$ 1 644 716	6 549	(463)	6 086	0,14	
07/2023		¥	4 029 015	€ 26 873	1 320	0	1 320	0,03	
07/2023		\$	553 613	514 883	7 447	0	7 447	0,17	
08/2023		AUD	27 143	16 475	0	(76)	(76)	0,00	
08/2023		TWD	1 728 769	\$ 56 623	1 011	0	1 011	0,02	
08/2023		\$	91	CNY 625	0	(5)	(5)	0,00	
08/2023			1 553 626	€ 1 415 941	0	(6 150)	(6 150)	(0,14)	
08/2023			5 624	TWD 172 130	0	(88)	(88)	0,00	
BRC		07/2023	€	1 364	CAD 1 960	0	(7)	(7)	0,00
		07/2023		38 572	DKK 287 210	2	0	2	0,00
		07/2023		8 435	£ 7 236	5	(8)	(3)	0,00
		07/2023	£	49 719	€ 57 555	0	(381)	(381)	(0,01)
	07/2023	NOK	100 791	8 478	0	(145)	(145)	0,00	
	07/2023	SEK	112 037	9 635	127	0	127	0,00	
	08/2023	CNH	28	\$ 4	0	0	0	0,00	
	08/2023	DKK	287 132	€ 38 572	0	(3)	(3)	0,00	
	08/2023	\$	37 911	COP 161 511 195	265	0	265	0,01	
	09/2023	HKD	86 463	\$ 11 067	13	0	13	0,00	
	09/2023	ILS	190 231	53 181	1 620	0	1 620	0,04	
	CBK	07/2023	AUD	15 915	€ 9 897	187	0	187	0,00
		07/2023	€	4 395	AUD 7 227	14	0	14	0,00
		07/2023		992	£ 854	3	0	3	0,00
07/2023			189 631	\$ 204 571	0	(2 124)	(2 124)	(0,05)	
07/2023		MXN	304	18	0	0	0	0,00	
08/2023		TWD	1 799 846	58 961	1 061	0	1 061	0,02	
08/2023		\$	50	CNH 347	0	(2)	(2)	0,00	
09/2023			226	KRW 290 191	0	(4)	(4)	0,00	
10/2023			12 335	CLP 10 074 895	66	0	66	0,00	
CLY		08/2023	£	18	€ 21	0	0	0,00	
		07/2023	NOK	13 896	1 156	0	(33)	(33)	0,00
		GLM	07/2023	\$	43 705	COP 184 476 458	320	0	320
DUB		07/2023		2 394	MXN 41 984	45	0	45	0,00
		08/2023		155	ZAR 2 877	0	(3)	(3)	0,00
	09/2023		73 259	BRL 370 780	2 497	0	2 497	0,06	
JPM	07/2023	CHF	420	€ 433	3	0	3	0,00	
	07/2023	DKK	266 393	35 771	0	(7)	(7)	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
	07/2023	€ 4 964	DKK 36 967	€ 1	€ 0	€ 1	0,00
	07/2023	8 520	¥ 1 267 600	0	(480)	(480)	(0,01)
	07/2023	1 032	SEK 11 985	0	(14)	(14)	0,00
	07/2023	240 155	\$ 259 037	60	(2 784)	(2 724)	(0,06)
	07/2023	£ 2 555	€ 2 960	0	(17)	(17)	0,00
	07/2023	¥ 632 439	4 247	236	0	236	0,01
	07/2023	SEK 150 158	13 009	267	0	267	0,01
	08/2023	DKK 36 957	4 964	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$ 96	CNY 660	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023	79 190	€ 72 424	0	(62)	(62)	0,00
	08/2023	146 440	HUF 50 867 136	667	(272)	395	0,01
	09/2023	ILS 182 549	\$ 51 390	1 881	0	1 881	0,04
	09/2023	\$ 72 247	INR 5 954 234	112	0	112	0,00
	09/2023	81 734	PEN 300 945	715	0	715	0,02
	10/2023	MXN 926 676	\$ 52 778	0	(181)	(181)	0,00
MBC	07/2023	CAD 166 122	€ 114 646	59	(483)	(424)	(0,01)
	07/2023	€ 2 917	DKK 21 724	1	0	1	0,00
	07/2023	164 832	£ 142 326	1 015	0	1 015	0,02
	07/2023	76 829	¥ 12 108 044	0	(37)	(37)	0,00
	07/2023	158 565	\$ 173 387	360	0	360	0,01
	07/2023	£ 168 418	€ 194 358	0	(1 893)	(1 893)	(0,05)
	07/2023	¥ 14 680 286	98 295	5 187	0	5 187	0,12
	07/2023	SGD 18	\$ 14	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 51 135	CLP 42 088 907	1 064	0	1 064	0,02
	08/2023	DKK 21 718	€ 2 917	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	£ 142 494	164 832	0	(1 004)	(1 004)	(0,02)
	08/2023	¥ 12 073 884	76 829	20	0	20	0,00
	08/2023	\$ 41	CNH 290	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	¥ 15 410 000	€ 99 459	877	0	877	0,02
	09/2023	KRW 54 875 510	\$ 43 029	1 102	0	1 102	0,03
MYI	07/2023	AUD 10	€ 6	0	0	0	0,00
	07/2023	CHF 27 918	28 759	155	0	155	0,00
	07/2023	€ 2 949	CAD 4 261	7	(5)	2	0,00
	07/2023	124	CHF 121	0	0	0	0,00
	07/2023	1 920	£ 1 658	12	0	12	0,00
	07/2023	41 929	¥ 6 271 800	0	(2 152)	(2 152)	(0,05)
	07/2023	446	\$ 486	0	0	0	0,00
	07/2023	£ 55	€ 64	0	0	0	0,00
	07/2023	¥ 415 400	2 775	140	0	140	0,00
	07/2023	\$ 49 290	46 119	940	0	940	0,02
	08/2023	TWD 1 891 449	\$ 62 367	1 486	0	1 486	0,03
	09/2023	CLP 2 037 963	2 542	23	0	23	0,00
	09/2023	KRW 61 671 203	48 191	1 085	0	1 085	0,02
	09/2023	\$ 6 308	INR 520 340	14	0	14	0,00
RBC	07/2023	CAD 4 692	€ 3 273	23	0	23	0,00
	07/2023	\$ 202	MXN 3 878	22	0	22	0,00
	08/2023	1 156	20 029	2	0	2	0,00
RYL	07/2023	€ 2 224	CAD 3 222	8	0	8	0,00
SCX	07/2023	1 040	AUD 1 715	6	0	6	0,00
	07/2023	20 479	NOK 240 775	120	0	120	0,00
	07/2023	NOK 202 909	€ 17 174	0	(186)	(186)	0,00
	07/2023	\$ 23 965	CLP 19 294 070	7	0	7	0,00
	08/2023	NOK 240 874	€ 20 479	0	(120)	(120)	0,00
	08/2023	TWD 24 582	\$ 805	14	0	14	0,00
	09/2023	2 886 012	94 661	1 644	0	1 644	0,04
	09/2023	\$ 45 215	INR 3 723 883	42	0	42	0,00
SOG	07/2023	1 622 785	€ 1 508 530	21 102	0	21 102	0,49
	07/2023	1 291	PLN 5 560	70	0	70	0,00
SSB	07/2023	CLP 40 670 241	\$ 50 601	0	(93)	(93)	0,00
	10/2023	\$ 49 984	CLP 40 670 241	92	0	92	0,00
UAG	07/2023	CHF 6 557	€ 6 780	62	0	62	0,00
	07/2023	€ 6 195	AUD 10 046	19	(85)	(66)	0,00
	07/2023	2 076	CAD 2 976	0	(15)	(15)	0,00
	07/2023	41 376	CHF 40 483	108	(7)	101	0,00
	07/2023	1 730	¥ 259 400	0	(85)	(85)	0,00
	07/2023	£ 136 140	€ 156 513	0	(2 125)	(2 125)	(0,05)
	07/2023	¥ 13 690 000	96 049	9 180	0	9 180	0,22
	07/2023	\$ 458	TRY 10 563	0	(51)	(51)	0,00
	08/2023	CHF 37 615	€ 38 487	0	(113)	(113)	0,00
	08/2023	\$ 52 222	ZAR 1 002 848	589	(23)	566	0,01
	09/2023	ILS 157 989	\$ 44 127	1 309	0	1 309	0,03
	09/2023	¥ 13 440 000	€ 90 390	4 541	0	4 541	0,11
				€ 83 521	€ (27 114)	€ 56 407	1,32

Tableau des investissements Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	3	€	2	€	0,00
	07/2023	€	89	AUD	146	€	0,00
JPM	07/2023	AUD	5	€	3	€	0,00
MYI	07/2023	€	37	AUD	59	€	0,00
RBC	07/2023		110		180	€	0,00
RYL	07/2023		6		10	€	0,00
SCX	07/2023		86		143	€	0,00
UAG	07/2023	AUD	12	€	7	€	0,00
				€	2	€	0,00
					(2)	€	0,00

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€	958	CHF	927	€	0,00
BRC	07/2023		427		415	€	0,00
MBC	07/2023	CHF	34	€	35	€	0,00
MYI	07/2023		63		65	€	0,00
	07/2023	€	576	CHF	560	€	0,00
UAG	07/2023	CHF	963	€	984	€	0,00
	07/2023	€	960	CHF	929	€	0,00
	08/2023		943		922	€	0,00
				€	3	€	0,00
					(25)	€	0,00

Au 30 juin 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	07/2023	£	70 020	€	81 280	€	(0,01)
BRC	07/2023	€	200 877	£	173 140	€	0,02
	07/2023	£	22 238	€	25 821	€	0,00
CLY	07/2023	€	5 925	£	5 095	€	0,00
	07/2023	£	9 667	€	11 283	€	0,00
DUB	07/2023	€	31	£	27	€	0,00
	07/2023	£	52	€	61	€	0,00
JPM	07/2023	€	228 554	£	196 670	€	0,02
MBC	07/2023		178 584		154 749	€	0,04
	07/2023	£	171 097	€	198 155	€	(0,03)
	08/2023	€	197 813	£	171 005	€	0,03
RBC	07/2023		5 917		5 108	€	0,00
RYL	07/2023		206		178	€	0,00
SOG	07/2023	£	975	€	1 134	€	0,00
UAG	07/2023	€	87 886	£	76 442	€	0,03
				€	1 190	€	0,03
					(1)	€	0,03

Au 30 juin 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	07/2023	€	1 388	ILS	5 600	€	0,00
	07/2023	ILS	81	€	20	€	0,00
	08/2023	€	13	ILS	52	€	0,00
CBK	07/2023		1 388		5 600	€	0,00
	07/2023	ILS	137	€	35	€	0,00
MBC	07/2023	€	1 388	ILS	5 600	€	0,00
	07/2023	ILS	315	€	79	€	0,00
	08/2023	€	14	ILS	57	€	0,00
MYI	07/2023		158		615	€	0,00
				€	3	€	0,00
					(21)	€	0,00

Au 30 juin 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	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	07/2023	€ 27 710	SGD 40 144	€ 0	€ (522)	€ (522)	(0,02)
	07/2023	SGD 904	€ 625	13	0	13	0,00
	08/2023	53	€ 36	0	0	0	0,00
GLM	07/2023	€ 27 711	SGD 40 144	0	(523)	(523)	(0,01)
	07/2023	SGD 1 467	€ 994	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	€ 27 712	SGD 40 144	0	(524)	(524)	(0,01)
	07/2023	SGD 204	€ 140	1	0	1	0,00
SOG	07/2023	140	95	1	0	1	0,00
UAG	07/2023	831	571	8	0	8	0,00
				€ 23	€ (1 569)	€ (1 546)	(0,04)

Au 30 juin 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	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	07/2023	\$ 11 570	€ 10 662	€ 67	€ (11)	€ 56	0,00
BOA	07/2023	€ 109 268	\$ 117 440	0	(1 624)	(1 624)	(0,04)
	07/2023	\$ 307	€ 285	4	0	4	0,00
BPS	07/2023	€ 106 139	\$ 114 100	0	(1 556)	(1 556)	(0,04)
	07/2023	\$ 108 713	€ 99 217	0	(427)	(427)	(0,01)
	08/2023	€ 99 217	\$ 108 865	431	0	431	0,01
BRC	07/2023	\$ 564	€ 515	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2023	108 556	99 848	347	0	347	0,01
	08/2023	€ 99 848	\$ 108 708	0	(344)	(344)	(0,01)
CLY	07/2023	\$ 3 193	€ 2 978	52	0	52	0,00
DUB	07/2023	4 130	3 806	20	0	20	0,00
JPM	07/2023	€ 31 863	\$ 34 067	0	(638)	(638)	(0,01)
	07/2023	\$ 109 024	€ 99 848	0	(82)	(82)	0,00
	08/2023	€ 99 848	\$ 109 177	85	0	85	0,00
MBC	07/2023	15 277	16 387	0	(257)	(257)	(0,01)
	07/2023	\$ 16 078	€ 15 002	265	0	265	0,01
MYI	07/2023	435	395	0	(3)	(3)	0,00
RBC	07/2023	388	356	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	9 047	8 280	14	(26)	(12)	0,00
SOG	07/2023	€ 106 139	\$ 114 178	0	(1 485)	(1 485)	(0,03)
				€ 1 285	€ (6 454)	€ (5 169)	(0,12)

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ 50 767 1,19

Total des Investissements

€ 5 015 615 117,79

Autres actifs et passifs à court terme

€ (757 404) (17,79)

Actifs nets

€ 4 258 211 100,00

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) Titres 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 1 135 € (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 sur actions cotées au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 163 012 € (31 décembre 2022 : 287 910 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 4 020 € (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. (ISDA) au 30 juin 2023.

Tableau des investissements Fonds Dynamic 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 30 juin 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	€ 373 327	€ 3 873 229	€ 319	€ 4 246 875
Fonds d'investissement	404 018	15 843	0	419 861
Contrats de mise en pension	0	329 566	0	329 566
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	1 520	17 793	0	19 313
Totaux	€ 778 865	€ 4 236 431	€ 319	€ 5 015 615

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	€ 56	€ 0	€ 56	€ 50	€ 0	€ 50
BOA	(3 154)	3 090	(64)	3 446	(3 570)	(124)
BPS	5 516	(4 460)	1 056	4 322	(10 200)	(5 878)
BRC	1 693	(440)	1 253	(7 900)	5 060	(2 840)
CBK	(800)	730	(70)	10 257	(9 740)	517
CLY	83	0	83	(8)	0	(8)
DUB	(13)	0	(13)	12 986	(12 970)	16
GLM	2 336	(1 720)	616	(7 033)	6 920	(113)
GST	S/O	S/O	S/O	(2)	0	(2)
JPM	101	200	301	7 259	(7 080)	179
MBC	7 473	(7 780)	(307)	36 023	(33 640)	2 383
MEI	S/O	S/O	S/O	80	(4 040)	(3 960)
MYI	1 692	(1 468)	224	(126)	0	(126)
RBC	82	(150)	(68)	(3 115)	2 470	(645)
RYL	9	0	9	(7 748)	7 780	32
SCX	1 516	(1 580)	(64)	(15 297)	14 720	(577)
SOG	19 686	(21 650)	(1 964)	(1 445)	1 300	(145)
SSB	(1)	0	(1)	S/O	S/O	S/O
UAG	14 492	(15 120)	(628)	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	78,89	65,24
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	20,85	15,48
Autres valeurs mobilières	0,00	0,05
Fonds d'investissement	9,86	9,86
Contrats de mise en pension	7,74	2,44
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,08)	0,48
Instruments financiers dérivés compensés	(0,66)	(1,15)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,19	0,61
Contrats de prise en pension	S/O	(0,35)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	8,32	3,28
Obligations et billets convertibles	0,34	0,26
Agences du gouvernement américain	21,79	S/O
Obligations du Trésor américain	17,21	S/O
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	4,02	1,78
Titres adossés à des actifs	7,73	6,77
Émissions souveraines	3,99	0,72
Actions ordinaires	20,79	39,19
Titres privilégiés	0,00	S/O
Droits	S/O	0,00
Sociétés d'investissement immobilier	0,48	0,26
Instruments à court terme	15,07	28,51
Fonds d'investissement	9,86	9,86
Contrats de mise en pension	7,74	2,44
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,08)	0,51
Options achetées		
Options sur Indices	S/O	0,00
Options vendues		
Options sur Indices	S/O	(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	(0,86)	(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	0,00	0,00
Swaps de rendement total sur indices	(0,07)	0,01
Contrats de change à terme	1,32	1,12
Contrats de change à terme couverts	(0,06)	(0,57)
Autres actifs et passifs à court terme	(17,79)	6,99
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Local 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				ÉMISSIONS SOUVERAINES				REPUBLIQUE DANOISE			
ARGENTINE				Obligation internationale du gouvernement chinois				Realkredit Danmark A/S			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				2,600 % éch. 01/09/2032 CNY \$ 27 420 0,98				1,500 % éch. 01/10/2053 DDK 0 \$ 0 0,00			
Ville autonome de Buenos Aires				2,620 % éch. 25/09/2029 308 300 42 462 1,52				Total Danemark			
95,317 % éch.				3,020 % éch. 27/05/2031 162 700 22 995 0,83				0 0,00			
29/03/2024 (a) ARS 88 177 \$ 176 0,01				3,030 % éch. 11/03/2026 62 810 8 836 0,32				0 0,00			
95,645 % éch.				3,120 % éch. 25/10/2052 48 980 6 839 0,25				RÉPUBLIQUE DOMINICAINE			
22/02/2028 (a) 52 420 102 0,00				3,270 % éch. 19/11/2030 23 300 3 367 0,12				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Total Argentine 278 0,01				3,280 % éch. 03/12/2027 164 010 23 472 0,84				Billets de la Banque centrale de République dominicaine			
AZÉRBAÏDJAN				3,810 % éch. 14/09/2050 89 400 13 939 0,50				12,000 % éch. 03/10/2025 DOP 310 500 5 901 0,21			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Chine 149 330 5,36				13,000 % éch. 05/12/2025 1 128 200 22 010 0,79			
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				Total Colombie 149 640 5,37				13,000 % éch. 30/01/2026 442 100 8 649 0,31			
7,230 % éch. 17/03/2026 \$ 2 900 2 835 0,10				COLOMBIE				Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine			
BRÉSIL				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				13,625 % éch. 03/02/2033 1 214 600 27 311 0,98			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Empresas Publicas de Medellin ESP				13,625 % éch. 10/02/2034 483 800 11 049 0,40			
Banco BTG Pactual S.A.				7,625 % éch. 10/09/2024 COP 7 839 000 1 751 0,06				Total République dominicaine 74 920 2,69			
8,300 % éch. 15/08/2024 BRL 228 000 45 861 1,65				ÉMISSIONS SOUVERAINES				HONGRIE			
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				Obligation internationale du gouvernement colombien				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
0,000 % éch.				9,850 % éch. 28/06/2027 25 455 000 5 880 0,21				Banque de développement hongroise			
31/07/2023 (d)(g) \$ 485 1 0,00				TES colombien				6,500 % éch. 29/06/2028 \$ 13 200 13 091 0,47			
Oi S.A.				2,250 % éch.				Obligation internationale du gouvernement hongrois			
0,000 % éch. 25/02/2035 BRL 4 559 801 0,03				18/04/2029 (f) 40 003 389 8 660 0,31				4,500 % éch. 23/03/2028 HUF 1 272 700 3 263 0,11			
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				3,750 % éch. 25/02/2037 23 048 079 5 215 0,19				4,750 % éch. 24/11/2032 2 337 900 5 807 0,21			
9,850 % éch. 16/07/2032 194 259 37 146 1,33				4,750 % éch.				6,750 % éch. 22/10/2028 11 684 600 32 808 1,18			
Vale S.A.				04/04/2035 (f) 7 763 930 1 928 0,07				Total Hongrie 54 969 1,97			
0,000 % (g) 99 420 6 338 0,23				6,250 % éch. 09/07/2036 17 966 000 3 128 0,11				INDONÉSIE			
Total Brésil 90 147 3,24				7,000 % éch. 26/03/2031 62 521 200 12 633 0,45				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
ÎLES CAÏMANS				7,000 % éch. 30/06/2032 22 623 200 4 456 0,16				Obligation internationale du gouvernement indonésien			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				7,250 % éch. 18/10/2034 21 297 000 4 110 0,15				6,375 % éch. 15/08/2028 IDR 74 197 000 5 051 0,18			
Interoceanea Finance Ltd.				7,250 % éch. 26/10/2050 16 745 900 2 818 0,10				6,375 % éch. 15/04/2032 321 879 000 21 619 0,78			
0,000 % éch.				7,750 % éch. 18/09/2030 75 745 600 16 167 0,58				6,500 % éch. 15/02/2031 264 478 000 17 840 0,64			
30/11/2025 (d) \$ 253 233 0,01				9,250 % éch. 28/05/2042 68 284 600 14 639 0,53				7,000 % éch. 15/09/2030 523 608 000 36 345 1,31			
Kaisa Group Holdings Ltd.				13,250 % éch. 09/02/2033 73 797 400 20 853 0,75				7,000 % éch. 15/02/2033 157 625 000 11 094 0,40			
9,750 % éch. 28/09/2023 ^ 8 000 535 0,02				Total Colombie 102 238 3,67				7,125 % éch. 15/06/2038 148 515 000 10 518 0,38			
10,500 % éch.				RÉPUBLIQUE TCHÈQUE				7,125 % éch. 15/06/2042 34 279 000 2 392 0,09			
15/01/2025 ^ 1 900 127 0,00				ÉMISSIONS SOUVERAINES				7,125 % éch. 15/06/2043 104 185 000 7 367 0,26			
10,875 % éch.				Obligation internationale du gouvernement de République tchèque				7,500 % éch. 15/06/2035 236 780 000 17 119 0,61			
23/07/2023 ^ 500 32 0,00				0,950 % éch. 15/05/2030 CZK 511 840 18 776 0,67				7,500 % éch. 15/05/2038 109 016 000 7 932 0,28			
11,700 % éch.				1,200 % éch. 13/03/2031 381 000 13 951 0,50				7,500 % éch. 15/04/2040 164 179 000 11 875 0,43			
11/11/2025 ^ 1 900 127 0,00				1,750 % éch. 23/06/2032 144 700 5 417 0,20				8,250 % éch. 15/05/2029 83 961 000 6 172 0,22			
Poinsettia Finance Ltd.				2,000 % éch. 13/10/2033 297 100 11 062 0,40				8,375 % éch. 15/03/2034 199 861 000 15 344 0,55			
6,625 % éch. 17/06/2031 7 611 6 290 0,23				2,750 % éch. 23/07/2029 426 500 17 846 0,64				Total Indonésie 170 668 6,13			
Total Îles Caïmans 7 344 0,26				3,500 % éch. 30/05/2035 146 600 6 253 0,23				INTERNATIONALES			
CHILI				4,200 % éch. 04/12/2036 149 900 6 784 0,24				CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				4,900 % éch. 14/04/2034 23 300 1 124 0,04				Project Mercury			
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				5,000 % éch. 30/09/2030 277 000 13 208 0,47				TBD % éch. 17/07/2030 € 5 000 5 455 0,20			
2,300 % éch. 01/10/2028 CLP 6 890 000 7 414 0,27				Total République tchèque 94 421 3,39				State Oil Company of the Azerbaijan Republic			
4,500 % éch. 15/10/2023 180 447 222 0,01				DANEMARK				TBD % éch. 26/11/2024 \$ 10 933 10 660 0,38			
5,000 % éch. 01/10/2028 10 105 000 12 410 0,45				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Internationales 16 115 0,58			
6,000 % éch. 01/04/2033 46 955 000 61 969 2,22				Jyske Realcredit A/S				IRLANDE			
6,000 % éch. 01/01/2043 655 000 905 0,03				1,500 % éch. 01/10/2053 DKK 0 0 0,00				TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
7,000 % éch. 01/05/2034 530 000 761 0,03				Nordea Kredit Realcreditaktieselskab				Black Diamond CLO DAC			
Total Chili 83 681 3,01				1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00				4,060 % éch. 20/01/2032 € 753 810 0,03			
CHINE				1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00				BNPP AM Euro CLO DAC			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Chine 149 640 5,37				3,777 % éch. 15/04/2031 500 534 0,02			
Flourish Century				REPUBLIQUE DOMINICAINE							
6,600 % éch.				Realkredit Danmark A/S							
04/02/2022 ^ (j) \$ 2 800 310 0,01				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	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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 Euro CLO DAC 3,877 % éch. 15/01/2031	€ 4 580	\$ 4 891	0,18	Emission d'investissement du gouvernement malaisien 3,422 % éch. 30/09/2027	MYR 58 100	\$ 12 367	0,44	6,150 % éch. 12/08/2032	PEN 20 606	\$ 5 449	0,20
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,073 % éch. 15/11/2031	1 900	2 034	0,07	3,447 % éch. 15/07/2036	24 190	4 884	0,18	6,900 % éch. 12/08/2037	6 000	1 643	0,06
Dryden Euro CLO DAC 4,183 % éch. 15/05/2034	7 400	7 900	0,28	3,465 % éch. 15/10/2030	105 520	22 119	0,79	7,300 % éch. 12/08/2033	194 300	55 348	1,99
Total Irlande		16 169	0,58	3,990 % éch. 15/10/2025	85 989	18 643	0,67	Total Pérou		101 290	3,64
ISRAËL				4,130 % éch. 09/07/2029	55 160	12 076	0,43	PHILIPPINES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,193 % éch. 07/10/2032	108 555	23 855	0,86	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % éch. 18/07/2033 (l)	\$ 2 100	2 081	0,07	4,258 % éch. 26/07/2027	14 130	3 107	0,11	Obligation internationale du gouvernement philippin	PHP 52 000	939	0,03
ÉMISSIONS SOUVERAINES				4,369 % éch. 31/10/2028	220 103	48 759	1,75	6,750 % éch. 15/09/2032	105 040	1 955	0,07
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS 76 200	20 275	0,73	4,417 % éch. 30/09/2041	33 593	7 440	0,27	Total Philippines		2 894	0,10
Total Israël		22 356	0,80	Total Malaisie		281 690	10,11	POLOGNE			
CÔTE D'IVOIRE				ACTIONS				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				ACTIONS ORDINAIRES				Obligation internationale du gouvernement polonais			
République de Côte d'Ivoire 7,985 % éch. 19/03/2027	€ 6 320	6 723	0,24	Hipotecaria Su Casita S.A. (c)	212 074	0	0,00	1,250 % éch. 25/10/2030	PLN 30 486	5 595	0,20
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				1,750 % éch. 25/04/2032	26 500	4 767	0,17
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				America Movil S.A.B. de C.V. 8,460 % éch. 18/12/2036	MXN 1 800	93	0,00	2,500 % éch. 25/07/2027	19 800	4 327	0,16
Corsair International Ltd. 7,772 % éch. 28/01/2027	4 400	4 776	0,17	Corp. GEO S.A.B. de C.V. 8,875 % éch. 25/09/2014 ^	\$ 250	0	0,00	2,750 % éch. 25/04/2028 (k)	243 700	52 970	1,90
8,122 % éch. 28/01/2029	2 800	3 032	0,11	9,250 % éch. 30/06/2020 ^	700	0	0,00	2,750 % éch. 25/10/2029	107 700	22 643	0,81
Total Jersey, Îles Anglo-normandes		7 808	0,28	Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. 9,620 % éch. 28/06/2016 ^	MXN 22 130	0	0,00	3,750 % éch. 25/05/2027	72 600	16 704	0,60
ACTIONS				Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. 8,790 % éch. 09/12/2014 ^	29 700	0	0,00	6,000 % éch. 25/10/2033	54 000	13 528	0,49
ACTIONS ORDINAIRES						93	0,00	7,500 % éch. 25/07/2028 (k)	86 700	23 058	0,83
DrillCo Holding Lux S.A. (c)	3 120	60	0,00	ÉMISSIONS SOUVERAINES				Total Pologne		143 592	5,16
DrillCo Holding Lux S.A. (c)(j)	7 882	151	0,01	Obligation internationale du gouvernement mexicain				QATAR			
Total des Actions ordinaires		211	0,01	5,500 % éch. 04/03/2027	1 644 100	85 106	3,06	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
VALEUR NOMINALE (en milliers)				5,750 % éch. 05/03/2026	253 900	13 496	0,48	QNB Finance Ltd. 6,900 % éch. 23/01/2025	IDR 276 200 000	18 447	0,66
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				7,000 % éch. 03/09/2026	172 700	9 408	0,34	ROUMANIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature) 3,000 % éch. 31/12/2026 (b)	\$ 341	202	0,01	7,500 % éch. 03/06/2027	697 100	38 596	1,39	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
FORESEA Holding S.A. 7,500 % éch. 15/06/2030	137	121	0,00	7,500 % éch. 26/05/2033	241 300	12 983	0,47	Obligation internationale du gouvernement roumain			
Total Luxembourg		323	0,01	7,750 % éch. 29/05/2031	385 002	21 267	0,76	3,650 % éch. 28/07/2025	RON 42 200	8 816	0,32
MALAISIE				7,750 % éch. 13/11/2042	322 900	16 911	0,61	4,150 % éch. 26/01/2028	77 600	15 449	0,55
ÉMISSIONS SOUVERAINES				8,000 % éch. 07/11/2047	278 900	14 893	0,53	4,250 % éch. 28/04/2036	103 700	17 796	0,64
Obligation internationale du gouvernement malaisien				8,000 % éch. 31/07/2053	138 700	7 353	0,26	4,750 % éch. 11/10/2034	62 000	11 509	0,41
2,632 % éch. 15/04/2031	MYR 74 660	14 724	0,53	8,500 % éch. 31/05/2029	608 600	35 120	1,26	4,850 % éch. 25/07/2029	6 600	1 322	0,05
3,582 % éch. 15/07/2032	85 804	18 056	0,65	8,500 % éch. 18/11/2038	522 200	29 720	1,07	5,000 % éch. 12/02/2029	12 600	2 557	0,09
3,733 % éch. 15/06/2028	30 750	6 628	0,24	Total Mexique		284 946	10,23	Total Roumanie		57 449	2,06
3,757 % éch. 22/05/2040	19 662	4 031	0,14	PAYS-BAS				RUSSIE			
3,800 % éch. 17/08/2023	176 400	37 824	1,36	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
3,885 % éch. 15/08/2029	26 300	5 678	0,20	Republic of Angola Via Avenir BV 10,163 % éch. 07/12/2023	\$ 1 580	1 572	0,06	Obligation internationale du gouvernement russe			
3,899 % éch. 16/11/2027	25 050	5 437	0,19	12,772 % éch. 03/07/2023	345	345	0,01	1,125 % éch. 20/11/2027 ^	€ 100	51	0,00
4,065 % éch. 15/06/2050	40 939	8 566	0,31	Total Pays-Bas		1 917	0,07	5,100 % éch. 28/03/2035 ^	\$ 1 200	534	0,02
4,254 % éch. 31/05/2035	35 492	7 774	0,28	NIGERIA				7,700 % éch. 23/03/2033 ^	RUB 1 088 800	4 380	0,16
4,504 % éch. 30/04/2029	6 420	1 434	0,05	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Russie		4 965	0,18
4,696 % éch. 15/10/2042	100	23	0,00	BOI Finance BV 7,500 % éch. 16/02/2027	€ 3 600	3 392	0,12	SERBIE			
4,762 % éch. 07/04/2037	79 180	18 265	0,66	ÉMISSIONS SOUVERAINES				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
				Obligation internationale du gouvernement péruvien				Obligation internationale du gouvernement serbe			
				5,350 % éch. 12/08/2040	PEN 2 300	533	0,02	4,500 % éch. 20/08/2032	RSD 371 800	3 070	0,11
				5,400 % éch. 12/08/2034	52 900	12 942	0,46	AFRIQUE DU SUD			
				5,940 % éch. 12/02/2029	93 600	25 375	0,91	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
								Banque de développement d'Afrique du Sud 8,600 % éch. 21/10/2024 (j)	ZAR 221 300	11 513	0,41
								Eskom Holdings SOC Ltd. 0,000 % éch. 18/08/2027 (d)	100 100	2 683	0,10
								0,000 % éch. 31/12/2032 (d)	254 000	2 858	0,10
								Total Afrique du Sud		17 054	0,61
								ÉMISSIONS SOUVERAINES			
								Obligation internationale du gouvernement sud-africain			
								2,000 % éch. 31/01/2025 (f)	69 734	3 583	0,13

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	
6,250 % éch. 31/03/2036	ZAR 114 500	\$ 3 871	0,14	EMIRATS ARABES UNIS				Residential Asset Securities Corp. Trust				
6,500 % éch. 28/02/2041	184 751	5 794	0,21	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				6,800 % éch. 25/07/2035	\$ 2 095	\$ 2 040	0,07	
7,000 % éch. 28/02/2031	665 346	28 203	1,01	ADCB Finance Cayman Ltd.				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust	5 124	3 295	0,12	
8,000 % éch. 31/01/2030	511 827	23 948	0,86	7,500 % éch. 15/10/2029	IDR 29 000 000	\$ 1 995	0,07	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
8,250 % éch. 31/03/2032	567 780	25 288	0,91	8,160 % éch. 29/04/2029	323 000 000	22 712	0,82	5,470 % éch. 25/07/2036	1 300	1 234	0,04	
8,500 % éch. 31/01/2037	697 900	28 264	1,02			24 707	0,89					
8,750 % éch. 31/01/2044	432 400	16 795	0,60	CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS								
8,875 % éch. 28/02/2035	213 800	9 276	0,33	NMC OpCo Ltd.				ACTIONS				
9,000 % éch. 31/01/2040	489 800	19 941	0,72	11,255 % éch. 25/03/2027	AED 28 858	7 935	0,28	ACTIONS ORDINAIRES				
10,500 % éch. 21/12/2026	1 961 732	107 847	3,88	Total Emirats arabes unis		32 642	1,17	ÉNERGIE				
10,500 % éch. 21/12/2026	590 000	32 435	1,16					Constellation Oil Services				
		305 245	10,97	ROYAUME-UNI				Holding S.A. « B »				
Total Afrique du Sud		322 299	11,58	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				(c)(j)	376 971	41	0,00	
CORÉE DU SUD				Petra Diamonds U.S. Treasury PLC (6,066 % en numéraire et 3,967 % de rémunération en nature)								
ÉMISSIONS SOUVERAINES				10,033 % éch. 08/03/2026		\$ 843	789	0,03				
Export-Import Bank of Korea	IDR 51 400 000	3 465	0,12	(b)								
7,250 % éch. 07/12/2024	2 800 000	189	0,01	TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
8,000 % éch. 15/05/2024				Canada Square Funding PLC				Ford Motor Credit Co. LLC				
Korea National Oil Corp.	\$ 6 300	6 182	0,22	5,316 % éch. 17/01/2059	£ 1 741	2 201	0,08	4,535 % éch. 06/03/2025	£ 400	484	0,02	
4,750 % éch. 03/04/2026				Polaris PLC		322	409	0,01	Rio Oil Finance Trust	\$ 2 904	2 923	0,10
Total Corée du Sud		9 836	0,35	6,154 % éch. 27/05/2057				8,200 % éch. 06/04/2028	836	844	0,03	
				Rochester Financing PLC		1 705	2 142	0,07	9,250 % éch. 06/07/2024	542	559	0,02
SUPRANATIONALES				5,602 % éch. 18/12/2044				9,750 % éch. 06/01/2027				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Stratton Mortgage Funding PLC		377	478	0,02				
Banque de développement asiatique	MXN 68 600	3 783	0,13	5,765 % éch. 12/03/2052								
4,700 % éch. 12/03/2024				Tower Bridge Funding PLC		1 302	1 648	0,06	CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Banque internationale pour la reconstruction et le développement	IDR 320 000 000	21 646	0,78	5,629 % éch. 20/12/2063				Ecopetrol S.A.	10 700	10 535	0,38	
6,250 % éch. 12/01/2028				Warwick Finance Residential Mortgages PLC		0	522	0,02	TBD % éch. 17/08/2024			
Société financière internationale	6 900 000	462	0,02	0,000 % éch. 21/12/2049 (d)								
8,000 % éch. 09/10/2023												
Total Supranationales		25 891	0,93									
				Total Royaume-Uni			8 189	0,29	TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
TANZANIE				ÉTATS-UNIS				Banc of America Mortgage Trust				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				3,896 % éch. 25/02/2036 ^	1	1	0,00	
Ministère des Finances et de la Planification, Gouvernement de la République unie de Tanzanie				Citigroup Mortgage Loan Trust				BCAP LLC Trust	3 337	3 009	0,11	
9,048 % éch. 26/04/2028	€ 8 182	8 804	0,32	5,450 % éch. 25/10/2036	\$ 432	278	0,01	3,676 % éch. 26/05/2037				
				5,470 % éch. 25/12/2036	1 267	712	0,03	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust	11	10	0,00	
THAÏLANDE				GSAMP Trust				3,887 % éch. 25/05/2047 ^				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				5,200 % éch. 25/12/2046	448	226	0,01	4,033 % éch. 25/01/2035	1	1	0,00	
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais	THB 72 330	1 754	0,06	5,240 % éch. 25/01/2037	878	514	0,02	4,042 % éch. 25/03/2035	6	6	0,00	
2,000 % éch. 17/06/2042				Lehman XS Trust				Bear Stearns ALT-A Trust				
2,350 % éch. 17/06/2026	1 871 124	53 034	1,90	5,058 % éch. 25/01/2036 ^	1 558	1 447	0,05	3,744 % éch. 25/04/2037	6 405	4 786	0,17	
2,650 % éch. 17/06/2028	2 263 201	64 825	2,33	MASTR Asset-Backed Securities Trust				4,117 % éch. 25/10/2035 ^	258	219	0,01	
2,875 % éch. 17/06/2046	73 500	1 970	0,07	6,300 % éch. 25/08/2037	646	536	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust	2 722	2 390	0,09	
3,350 % éch. 17/06/2033	68 650	2 067	0,07	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				4,321 % éch. 25/03/2034	1	1	0,00	
3,390 % éch. 17/06/2037	134 400	4 042	0,15	5,380 % éch. 25/11/2036	7 057	3 892	0,14	Countrywide Alternative Loan Trust				
3,400 % éch. 17/06/2036	477 854	14 374	0,52	5,450 % éch. 25/06/2036	169	143	0,01	5,510 % éch. 25/04/2046	100	89	0,00	
3,450 % éch. 17/06/2043	569 545	17 049	0,61	6,305 % éch. 25/01/2035	1 732	1 553	0,06	5,797 % éch. 20/12/2035	422	394	0,01	
3,775 % éch. 25/06/2032	108 429	3 377	0,12	NovaStar Mortgage Funding Trust				6,000 % éch. 25/06/2036	4 021	2 252	0,08	
4,875 % éch. 22/06/2029	438 082	14 047	0,51	5,490 % éch. 25/01/2037	1 742	610	0,02	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
				Option One Mortgage Loan Trust				3,884 % éch. 25/11/2037	318	291	0,01	
TURQUIE				5,370 % éch. 25/04/2037	481	341	0,01	5,950 % éch. 25/03/2035	37	32	0,00	
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				FWD Securitization Trust	562	511	0,02	
SOCAR Turkey Enerji A/S				5,885 % éch. 25/08/2035	87	83	0,00	2,240 % éch. 25/01/2050				
6,553 % éch. 11/08/2026	€ 9 900	10 477	0,38					GSMPS Mortgage Loan Trust				
								5,500 % éch. 25/01/2036	131	107	0,00	
								GSR Mortgage Loan Trust				
								3,935 % éch. 25/01/2036 ^	4	4	0,00	
								Impac CMB Trust				
								5,790 % éch. 25/03/2035	80	73	0,00	
								IndyMac Mortgage Loan Trust				
								3,062 % éch. 25/11/2037	204	167	0,01	
								5,490 % éch. 25/11/2036	5 293	5 138	0,18	
								5,510 % éch. 25/02/2037	382	369	0,01	
								JPMorgan Resecuritization Trust				
								2,500 % éch. 25/03/2056	160	151	0,01	
								Lehman XS Trust				
								5,530 % éch. 25/09/2046	1 470	1 258	0,05	
								Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
								6,115 % éch. 25/06/2036	1	1	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 AMÉRICAIN				INSTRUMENTS À COURT TERME				BONS DU TRÉSOR HONGROIS			
Fannie Mae				Amcor PLC				16,220 % éch.			
3,996 % éch. 01/07/2035	8	8	0,00	5,450 % éch. 07/07/2023	250	250	0,01	06/07/2023 (d)(e) HUF	20 973 000	61 221	2,20
Total États-Unis	54 876	54 876	1,97	Dominion Resources, Inc.	250	249	0,01	Total des Instruments à court terme		78 844	2,83
URUGUAY				BILLETS DE TRÉSORERIE				FONDS D'INVESTISSEMENT			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Enbridge, Inc.				ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
Obligation internationale du gouvernement uruguayen				5,440 % éch. 20/07/2023	4 900	4 885	0,17	PIMCO Funds: Global			
3,700 % éch. 26/06/2037 (f) UYU	140 338	3 893	0,14	5,450 % éch. 26/07/2023	500	498	0,02	Investors Series plc -			
3,875 % éch. 02/07/2040 (f)(k)	260 887	7 359	0,26	5,430 % éch. 13/07/2023	300	299	0,01	Fonds Asia Strategic	250 000	2 235	0,08
Total Uruguay	11 252	11 252	0,40	5,480 % éch. 17/07/2023	1 100	1 097	0,04	Interest Bond Fund (h)			
ZAMBIE				Enel Finance America LLC				PIMCO Funds: Global			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				5,450 % éch. 24/07/2023				Investors Series plc -			
Obligation internationale du gouvernement zambien				Mondelēz International, Inc.	1 300	1 295	0,04	Fonds Emerging Local			
13,000 % éch. 25/01/2031 ZMW	145 000	4 876	0,18	5,370 % éch. 25/07/2023	500	499	0,02	Bond ESG Fund (h)	122 324	1 450	0,05
				5,430 % éch. 19/07/2023				PIMCO Funds: Global			
				5,430 % éch. 13/07/2023				Investors Series plc -			
				5,450 % éch. 13/07/2023				Fonds PIMCO Emerging			
				5,480 % éch. 17/07/2023				Markets Opportunities			
				5,450 % éch. 13/07/2023				Fund (h)			
				5,450 % éch. 13/07/2023				2 453 310			
				5,450 % éch. 13/07/2023				26 103			
				5,450 % éch. 13/07/2023				0,94			
				5,450 % éch. 13/07/2023				23 593 014			
				5,450 % éch. 13/07/2023				234 938			
				5,450 % éch. 13/07/2023				8,43			
				5,450 % éch. 13/07/2023				384 409			
				5,450 % éch. 13/07/2023				5 010			
				5,450 % éch. 13/07/2023				0,18			
				5,450 % éch. 13/07/2023				269 736			
				5,450 % éch. 13/07/2023				9,68			
				5,450 % éch. 13/07/2023				269 736			
				5,450 % éch. 13/07/2023				9,68			

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 septembre	Court	09/2023	91	\$ 150	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Long	09/2023	36	(50)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	62	120	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	3	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	3	(5)	0,00
				\$ 219	0,01
				\$ 219	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 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
Barclays Bank PLC	1,000 %	20/12/2023	€ 1 200	\$ 0	0,00
General Electric Co.	1,000 %	20/12/2023	\$ 1 100	(12)	0,00
				\$ (12)	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 recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250 %	16/03/2032	INR 1 538 910	\$ 319	0,01
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,750 %	15/03/2028	1 480 963	267	0,01
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750 %	15/03/2028	SGD 4 900	(48)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250 %	21/06/2028	\$ 26 400	1 000	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	4,870 %	02/01/2024	BRL 242 300	(4 718)	(0,17)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,660 %	02/01/2025	183 200	(3 524)	(0,13)

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	CDI BRL à 1 an	5,680 %	02/01/2024	BRL 19 200	\$ (324)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	6,140	04/01/2027	528 200	(9 141)	(0,33)
À payer	CDI BRL à 1 an	6,710	02/01/2025	13 900	(209)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	6,950	04/01/2027	800	(11)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	7,480	02/01/2025	119 400	(1 560)	(0,06)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,075	02/01/2024	120 000	1 951	0,07
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,675	04/01/2027	19 900	172	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	10,565	04/01/2027	259 100	570	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,140	04/01/2027	157 000	1 393	0,05
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,244	02/01/2026	198 600	(789)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,405	02/01/2029	13 600	61	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,420	02/01/2026	226 000	1 024	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	11,810	02/01/2025	75 920	148	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,845	02/01/2025	186 600	134	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	12,005	02/01/2025	177 400	124	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	12,090	04/01/2027	127 500	1 147	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	12,091	04/01/2027	103 330	930	0,03
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,350	01/07/2024	288 000	(149)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,425	02/01/2025	172 800	369	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,490	01/07/2024	312 400	(247)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,533	02/01/2029	96 500	(1 260)	(0,04)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,595	01/07/2024	276 600	304	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	12,684	02/01/2029	104 300	1 449	0,05
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,740	02/01/2025	42 600	(173)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,746	02/01/2029	114 100	1 626	0,06
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,850	02/01/2025	67 400	(286)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	13,080	01/07/2024	542 300	1 070	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,218	02/01/2029	212 500	(3 592)	(0,13)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,250	21/12/2027	CNY 151 070	377	0,01
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	16/03/2027	197 410	398	0,02
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,625	16/12/2025	30 320	41	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	15/03/2028	108 240	171	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,125	15/01/2026	COP 3 301 000	50	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,005	20/08/2028	53 353 700	(771)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,075	26/11/2025	13 240 170	255	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,115	01/02/2031	14 558 000	144	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,120	01/02/2031	10 388 000	103	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,155	15/01/2031	5 060 000	56	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,175	28/05/2027	32 437 000	(722)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,675	18/06/2031	20 000 000	431	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,130	26/10/2026	10 907 100	174	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,630	07/10/2031	12 820 000	(173)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,640	11/01/2027	31 028 800	395	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,660	07/10/2031	6 347 000	(83)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,670	11/01/2027	47 000 000	587	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,690	07/10/2031	6 347 000	(80)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,040	25/01/2027	30 993 600	283	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,080	02/02/2027	9 610 900	82	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,130	31/01/2027	14 472 000	120	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,140	01/02/2027	29 583 000	239	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,380	21/01/2029	9 688 000	33	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,585	14/02/2027	35 037 000	(146)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,860	26/08/2026	12 602 700	40	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,890	08/04/2027	21 093 600	53	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,913	08/04/2027	32 467 300	75	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,940	08/04/2027	16 342 600	34	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,190	13/06/2029	43 754 800	340	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,200	11/03/2027	45 342 000	70	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,240	15/03/2027	15 813 700	31	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,305	28/04/2028	30 230 500	183	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,320	31/03/2027	10 203 000	32	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,360	02/06/2027	58 618 000	192	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,390	13/06/2028	15 910 800	115	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,495	27/04/2030	42 159 000	493	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,560	30/03/2027	4 356 600	21	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,610	26/11/2025	15 715 400	23	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,686	30/03/2027	25 932 000	152	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,820	05/06/2028	41 957 200	(465)	(0,02)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,940	24/03/2030	57 343 000	(1 062)	(0,04)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,040	05/05/2030	15 100 700	285	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,130	23/03/2030	59 209 100	(1 230)	(0,04)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,177	26/11/2025	18 899 000	(29)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,300	26/03/2031	36 903 760	(951)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,370	17/03/2030	15 942 100	(376)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,393	21/03/2030	37 252 900	(890)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,423	17/03/2030	47 175 600	(1 142)	(0,04)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,490	30/06/2032	9 544 300	305	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,790	20/01/2028	45 916 600	807	0,03
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,800	17/01/2028	54 120 000	949	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,820	27/02/2033	9 049 540	(341)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,110	26/11/2025	9 311 000	(60)	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,130	25/01/2028	42 970 500	898	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 recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,400 %	21/11/2029	COP	4 122 900	\$ (141)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,500	21/03/2025		194 830 310	615	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,990	21/11/2025		16 209 500	(178)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,030	21/11/2025		15 885 200	(178)	(0,01)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,210	17/06/2025	ILS	7 100	60	0,00
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,590	18/05/2028		30 500	(19)	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,665	15/03/2028	KRW	15 946 900	(104)	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2033		82 062 061	(719)	(0,03)
À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	15/03/2028	THB	3 347 720	22	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,635	04/02/2027	ZAR	53 800	28	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,120	26/05/2030		88 500	(411)	(0,01)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,205	22/04/2027		178 200	412	0,02
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,210	22/04/2027		137 000	315	0,01
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,250	19/09/2023		142 300	(608)	(0,02)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,460	06/03/2030		107 650	(40)	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,565	22/03/2026		300 200	340	0,01
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,030	04/01/2028		152 000	(174)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,120	13/03/2028		4 890	(5)	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,276	28/02/2028		263 600	(199)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,830	23/02/2030		78 400	(44)	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	9,290	26/05/2028		335 100	327	0,01
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	9,350	18/05/2028		139 300	210	0,01
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	10,150	18/05/2033		121 800	253	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,080	01/06/2030	CLP	3 688 000	(207)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,110	01/06/2030		1 385 000	(76)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,000	07/01/2030		4 970 000	(705)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,060	08/01/2030		4 500 000	(648)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,120	05/02/2030		1 679 000	(222)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,215	14/01/2030		9 767 400	1 443	0,05
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,420	01/09/2030		1 005 150	124	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,725	19/07/2028		2 502 900	316	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,731	20/07/2028		13 716 000	1 727	0,06
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,920	06/08/2028		9 384 500	1 032	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,990	06/07/2028		5 482 000	623	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,000	06/07/2028		2 901 000	322	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,410	01/09/2030		2 839 400	219	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,870	01/10/2028		3 460 000	(137)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,015	13/09/2028		1 869 500	(67)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,030	13/09/2028		6 500 000	(226)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,030	20/03/2033		14 730 340	370	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,180	01/10/2028		1 905 000	36	0,00
À recevoir ⁽³⁾	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,220	01/10/2028		4 896 800	(7)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,240	01/09/2030		3 103 000	35	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,250	01/10/2028		7 411 400	124	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,300	18/05/2033		5 292 000	(76)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,360	18/05/2033		2 594 000	(53)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,370	01/10/2028		1 735 700	13	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,400	01/10/2028		949 000	4	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,420	01/10/2028		2 094 000	10	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,460	01/10/2028		952 100	(1)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,550	05/06/2028		13 690 000	(149)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,570	01/10/2028		1 925 000	(8)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,620	01/10/2028		8 700 000	49	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,680	01/10/2028		2 490 200	(27)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,820	01/09/2030		1 514 470	(55)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,890	17/03/2032		1 533 000	(88)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,930	17/03/2032		1 533 100	(88)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,000	01/10/2028		5 006 600	143	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,010	16/02/2029		2 164 000	61	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,020	02/03/2029		1 250 400	41	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,100	01/04/2032		1 225 000	(94)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,115	01/04/2032		1 273 000	(102)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,250	01/10/2028		1 580 100	74	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,370	29/06/2029		4 532 000	356	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,420	24/03/2029		1 107 000	70	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,470	01/10/2028		3 085 000	(180)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,500	01/10/2028		2 650 000	(160)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,550	15/06/2032		2 352 600	314	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,580	01/10/2028		3 089 700	(201)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,590	16/06/2032		6 916 000	951	0,03
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,610	17/06/2032		2 813 000	394	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,640	01/10/2028		1 614 000	(113)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,650	01/10/2028		3 129 000	(217)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,090	22/07/2029		7 495 700	(776)	(0,03)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	01/10/2028		2 439 300	244	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,195	01/10/2028		1 355 100	141	0,01
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,611	06/06/2028	CZK	3 476 300	(515)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	€	2 700	(15)	0,00
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025		25 200	191	0,01
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,500	19/06/2024	HUF	5 281 500	(1 430)	(0,05)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,760	21/01/2030		1 296 900	(115)	0,00
À payer	BBR HUF à 6 mois	2,420	02/08/2026		3 964 700	(2 421)	(0,09)

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	BBR HUF à 6 mois	2,680 %	29/06/2031	HUF 1 938 800	\$ (1 104)	(0,04)
À payer	BBR HUF à 6 mois	4,790	17/01/2027	7 857 000	(3 353)	(0,12)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	8,500	17/01/2028	711 800	26	0,00
À payer	BBR HUF à 6 mois	8,670	23/05/2029	1 828 200	267	0,01
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	8,700	16/01/2028	1 002 200	14	0,00
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	8,740	28/04/2028	1 920 800	(124)	0,00
À payer	BBR HUF à 6 mois	9,230	26/08/2032	1 440 400	683	0,03
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,925	16/10/2030	PLN 1 500	(57)	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,163	03/12/2030	3 800	(145)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,460	28/05/2026	44 900	(1 177)	(0,04)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,490	29/08/2029	57 400	2 224	0,08
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	2,585	14/10/2029	15 200	371	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	2,920	13/12/2031	3 800	119	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,075	07/03/2027	37 000	408	0,02
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,220	20/03/2033	14 100	(33)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,310	21/03/2033	40 800	(166)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,520	20/03/2026	107 500	(33)	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,620	21/03/2026	115 400	47	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,870	22/04/2027	1 000	(6)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,960	25/04/2027	67 900	(435)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,456	25/05/2027	40 800	(456)	(0,02)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,480	25/05/2027	45 100	(513)	(0,02)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,560	25/05/2027	15 800	(191)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,830	19/08/2024	52 600	(502)	(0,02)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,890	22/08/2024	119 500	(1 171)	(0,04)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,310	30/06/2027	15 300	(292)	(0,01)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	6,540	31/05/2040	MXN 240 300	644	0,02
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,035	31/05/2029	83 200	52	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	8,207	19/06/2028	713 900	(233)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	8,300	16/06/2028	361 200	(45)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	9,335	02/08/2023	1 952 800	387	0,01
À payer	TIE MXN à 28 jours	9,500	03/07/2023	3 190 100	(300)	(0,01)
					\$ (16 541)	(0,59)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (16 553)	(0,59)

(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.

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 de vente - EUR contre CZK hors cote	CZK 23,830	01/11/2023	2 091	\$ 228	\$ 928	0,03
	Option d'achat - USD contre INR hors cote	INR 92,600	16/06/2025	2 200	132	19	0,00
GLM	Option de vente - USD contre INR hors cote	INR 92,600	16/06/2025	2 200	132	194	0,01
	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF 385,000	01/11/2023	788	105	476	0,02
JPM	Option de vente - EUR contre PLN hors cote	PLN 4,560	01/11/2023	1 575	188	1 238	0,05
	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF 385,000	01/11/2023	1 581	151	954	0,03
MYI	Option de vente - EUR contre PLN hors cote	PLN 4,560	01/11/2023	535	89	421	0,02
	Option de vente - EUR contre CZK hors cote	CZK 23,830	01/11/2023	687	410	305	0,01
RBC	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF 385,000	01/11/2023	606	225	366	0,01
	Option de vente - USD contre BRL hors cote	BRL 4,820	22/08/2023	26 361	281	394	0,01
UAG	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN 18,500	25/07/2023	25 738	647	1 907	0,07
	Option de vente - USD contre CAD hors cote	CAD 1,305	13/07/2023	25 584	114	16	0,00
UAG	Option d'achat - EUR contre USD hors cote	\$ 1,140	13/07/2023	23 246	146	0	0,00
	Option d'achat - USD contre ZAR hors cote	ZAR 20,500	09/10/2023	40 134	559	407	0,02
					\$ 3 407	\$ 7 625	0,28

OPTIONS DOUBLES (STRADDLE)							
Contrepartie	Description	Niveau d'exercice ⁽²⁾	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Coût ⁽²⁾	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600 %	27/12/2023	17 100	\$ 0	\$ 4	0,00
	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	15,050	27/12/2023	17 100	0	18	0,00
CBK	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	15,100	20/12/2023	51 900	0	9	0,00
	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600	29/12/2023	15 800	0	1	0,00
MYI	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600	27/12/2023	23 800	0	5	0,00
					\$ 0	\$ 37	0,00

OPTIONS VENDUES
OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description		Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
JPM	Option d'achat - USD contre INR hors cote	IDR	14 950,000	06/06/2024	7 776	\$ (263)	\$ (276)	(0,01)
	Option de vente - USD contre INR hors cote		14 950,000	06/06/2024	7 776	(238)	(197)	(0,01)
MYI	Option d'achat - USD contre CLP hors cote	CLP	850,000	18/07/2023	14 860	(211)	(20)	0,00
	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN	17,750	25/07/2023	51 476	(329)	(1 677)	(0,05)
	Option d'achat - USD contre MXN hors cote		21,000	07/03/2024	22 599	(504)	(159)	(0,01)
						\$ (1 545)	\$ (2 329)	(0,08)

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	3,380 %	31/07/2023	4 800	\$ (19)	\$ (23)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	4 800	(19)	(14)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	3 000	(10)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	3 000	(10)	(15)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	2 700	(6)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	2 700	(6)	(10)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	2 600	(9)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	2 600	(8)	(13)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	1 800	(4)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	1 800	(4)	(6)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	4 200	(14)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	4 200	(14)	(17)	0,00
						\$ (123)	\$ (125)	(0,01)	

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

(2) Niveau d'exercice et coût final déterminés à une date future sur la base des paramètres implicites de volatilité.

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 turc	(1,000) %	20/06/2024	\$ 8 200	\$ 486	\$ (325)	\$ 161	0,01
BPS	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/06/2024	3 000	162	(103)	59	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/06/2024	3 200	136	(73)	63	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/06/2024	3 800	158	(83)	75	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2024	2 700	165	(60)	105	0,01
GST	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/06/2024	29 700	1 409	(826)	583	0,02
					\$ 2 516	\$ (1 470)	\$ 1 046	0,04

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
BPS	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000 %	20/12/2023	\$ 500	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	1 800	(3)	6	3	0,00
CBK	Petroleos Mexicanos	1,000	20/06/2024	12 000	(371)	149	(222)	(0,01)
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30/06/2029	11 200	0	348	348	0,01
GST	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	1 200	4	1	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/06/2024	3 400	15	10	25	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20/12/2024	6 500	(146)	93	(53)	0,00
					\$ (499)	\$ 607	\$ 108	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) 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 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.

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

SWAPS SUR DEVICES CROISEES

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
GLM	Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,330 % sur la base du montant notional de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notional de la devise livrée	28/05/2024	USD 1 900	ARS 85 633	\$ 0	\$ 1 816	\$ 1 816	0,06
	Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,333 % sur la base du montant notional de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notional de la devise livrée	30/05/2024	4 820	214 249	(15)	4 627	4 612	0,17
	Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,282 % sur la base du montant notional de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notional de la devise livrée	07/06/2027	2 090	93 789	(3)	2 037	2 034	0,07
						\$ (18)	\$ 8 480	\$ 8 462	0,30

SWAPS DE TAUX D'INTERET

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 payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,680 %	08/09/2030	ILS 44 500	\$ 0	\$ (2 181)	\$ (2 181)	(0,08)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,800	24/04/2028	120 000	0	4 315	4 315	0,15
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,963	16/02/2028	21 300	0	(412)	(412)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998	20/06/2028	13 700	0	(282)	(282)	(0,01)
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	MYR 161 119	196	43	239	0,01
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	33 100	10	(59)	(49)	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	30 420	(91)	64	(27)	0,00
BRC	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,795	20/06/2028	ILS 32 000	0	1 123	1 123	0,04
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,950	20/06/2028	34 500	0	(730)	(730)	(0,03)
BSH	À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,300	21/06/2029	CLP 3 450 000	0	416	416	0,01
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,750	22/03/2026	8 000 000	0	(772)	(772)	(0,03)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,790	14/03/2026	3 885 000	7	(384)	(377)	(0,01)
CBK	À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,960	10/05/2029	COP 27 236 900	0	501	501	0,02
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,485	09/08/2024	ILS 68 500	0	886	886	0,03
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,950	23/05/2024	122 500	0	1 258	1 258	0,05
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,041	15/05/2024	101 800	0	(1 013)	(1 013)	(0,04)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,763	24/05/2029	CLP 1 841 700	10	(192)	(182)	(0,01)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,770	19/03/2026	64 800	0	(6)	(6)	0,00
CKL	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	2,100	20/06/2028	ILS 14 000	(46)	(225)	(271)	(0,01)
DUB	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,690	27/09/2027	20 100	0	611	611	0,02
GLM	À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,708	02/01/2025	BRL 18 800	0	(4)	(4)	0,00
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,520	12/08/2024	ILS 93 500	0	1 192	1 192	0,04
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,540	11/05/2027	11 600	0	(376)	(376)	(0,01)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,720	20/06/2028	8 800	0	317	317	0,01
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,820	15/01/2030	43 800	0	1 976	1 976	0,07
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,950	23/05/2024	75 700	0	777	777	0,03
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,960	24/05/2024	70 700	0	724	724	0,03
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,048	27/02/2024	132 400	0	(925)	(925)	(0,03)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,883	21/03/2028	28 100	0	(558)	(558)	(0,02)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,898	17/12/2025	57 400	0	(673)	(673)	(0,02)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,971	16/02/2028	43 600	0	(838)	(838)	(0,03)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998	20/06/2028	28 300	0	(583)	(583)	(0,02)
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,545	05/05/2028	MYR 118 027	0	139	139	0,01
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,990	01/08/2029	CLP 2 813 100	0	(514)	(514)	(0,02)
	À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,015	20/06/2026	5 555 000	0	554	554	0,02
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,265	14/06/2029	4 122 200	0	(518)	(518)	(0,02)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,830	22/05/2029	7 729 900	0	(735)	(735)	(0,03)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,095	01/06/2027	12 230 000	0	(847)	(847)	(0,03)
	À payer ⁽¹⁾	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,319	22/05/2029	19 808 000	0	(98)	(98)	0,00
GST	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	MYR 89 615	88	45	133	0,00
HUS	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,018	11/03/2024	ILS 82 600	0	(581)	(581)	(0,02)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,018	15/05/2024	91 500	0	(916)	(916)	(0,03)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998	20/06/2028	14 900	1	(308)	(307)	(0,01)
JPM	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,475	09/08/2024	71 500	0	929	929	0,03
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,813	20/06/2028	18 100	0	631	631	0,02
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,027	19/03/2024	37 000	0	(259)	(259)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,095	10/05/2024	ILS 19 800	0	(195)	(195)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	2,078	20/06/2028	12 600	0	(247)	(247)	(0,01)
	À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,540	04/06/2029	CLP 4 115 000	0	452	452	0,02
MYC	À payer	CDI BRL à 1 an	7,800	04/01/2027	BRL 12 200	17	(110)	(93)	0,00
						\$ 192	\$ 1 412	\$ 1 604	0,06

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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	07/2023	CZK	125 274	\$ 5 826	\$ 77	\$ 0	\$ 77	0,00	
	07/2023	KES	473 310	3 342	0	(7)	(7)	0,00	
	07/2023	PLN	2 247	528	0	(25)	(25)	0,00	
	07/2023	\$	1 659	1 312	9	0	9	0,00	
	07/2023		5 669	ILS	20 612	(111)	(111)	0,00	
	07/2023		1 298	MXN	23 891	0	92	0,00	
	07/2023		594	PEN	2 180	6	6	0,00	
	07/2023		7 001	PLN	29 115	160	160	0,01	
	08/2023	€	2 796	\$	3 071	15	15	0,00	
	08/2023	MXN	165 419		8 949	0	(622)	(0,02)	
	08/2023	NZD	7 024		4 454	152	152	0,01	
	08/2023	\$	242	AUD	358	0	(3)	0,00	
	08/2023		18 929	CNY	129 905	0	(957)	(0,03)	
	08/2023		711	EGP	23 675	32	32	0,00	
	08/2023		9 345	€	8 600	57	57	0,00	
	08/2023		0	ZAR	2	0	0	0,00	
	09/2023	CLP	3 996 762	\$	4 808	0	(131)	0,00	
	09/2023	NGN	310 612		536	143	143	0,01	
	09/2023	TWD	58 910		1 941	45	45	0,00	
	09/2023	\$	3 878	CLP	3 114 965	0	(31)	0,00	
	09/2023		236	HKD	1 848	0	0	0,00	
	09/2023		96	KRW	121 984	0	(3)	0,00	
	09/2023		13 217	MYR	60 532	0	(182)	(0,01)	
	09/2023		53	NGN	41 128	0	(1)	0,00	
	09/2023		40 443	THB	1 402 760	0	(580)	(0,02)	
	10/2023		897	KES	134 789	33	33	0,00	
	10/2023	ZAR	105 882	\$	5 706	156	156	0,01	
	11/2023	€	12 909	CZK	315 220	245	245	0,01	
	03/2030	\$	12 534	IDR	246 110 438	1 797	1 797	0,07	
BPS	07/2023	BRL	101 355	\$	20 567	66	(510)	(4,44)	(0,02)
	07/2023	CZK	26 475		1 229	14	14	0,00	
	07/2023	MYR	43 807		9 544	141	141	0,01	
	07/2023	PEN	7 872		2 159	0	(12)	(0,00)	
	07/2023	PHP	174 925		3 103	0	(59)	(0,00)	
	07/2023	PLN	20 360		4 922	0	(85)	(0,00)	
	07/2023	\$	13 755	BRL	68 601	466	466	0,02	
	07/2023		7 752	COP	35 048 976	607	607	0,02	
	07/2023		21 767	CZK	468 215	0	(281)	(0,01)	
	07/2023		128	€	118	0	0	0,00	
	07/2023		3 345	£	2 610	0	(26)	(0,00)	
	07/2023		2 914	¥	405 017	0	(112)	(0,00)	
	07/2023		80 003	MXN	1 400 000	1 485	1 485	0,05	
	07/2023		1 076	PEN	3 936	10	10	0,00	
	07/2023		9 270	PHP	519 318	118	118	0,00	
	07/2023		3 416	RON	15 889	77	77	0,00	
	08/2023	€	346	\$	380	1	1	0,00	
	08/2023	MYR	146 625		31 563	54	54	0,00	
	08/2023	TWD	29 486		966	19	19	0,00	
	08/2023	\$	13 886	CLP	11 459 287	349	349	0,01	
	08/2023		8 445	CNH	58 352	0	(397)	(0,01)	
	08/2023		44 289	CNY	304 030	0	(2 227)	(0,08)	
	08/2023		10 280	COP	46 160 753	680	680	0,02	
	08/2023		22 696	€	20 732	0	(30)	(0,00)	
	08/2023		24 766	ZAR	460 891	0	(468)	(0,02)	
	09/2023	PHP	1 115 619	\$	19 879	0	(254)	(0,01)	
	09/2023	\$	3 083	COP	13 088 753	0	(12)	(0,00)	
	09/2023		2 737	INR	225 096	0	(1)	(0,00)	
	09/2023		388	PEN	1 420	1	1	0,00	
	09/2023		3 571	THB	122 766	0	(82)	(0,00)	
	09/2023		2 362	ZAR	43 590	0	(71)	(0,00)	
	11/2023	€	8 500	CZK	203 104	0	(43)	(0,00)	
	11/2023	ILS	31 394	\$	9 118	602	602	0,02	
	12/2023	MXN	60 314		3 383	0	(29)	(0,00)	
	12/2023	NGN	93 960		116	1	1	0,00	
	01/2024	\$	1 147	EGP	37 804	0	(113)	(0,00)	
BRC	07/2023	PLN	2 455	\$	588	0	(16)	(0,00)	
	07/2023	RON	74 292		16 131	0	(205)	(0,01)	
	07/2023	\$	5 806	CZK	124 241	0	(104)	(0,00)	
	07/2023	\$	30 460	MYR	139 753	0	(462)	(0,02)	
	07/2023		2 992	PLN	12 588	104	104	0,00	
	07/2023		3 882	RON	17 366	0	(63)	(0,00)	
	08/2023	CNH	14 135	\$	1 994	44	44	0,00	
	08/2023	COP	113 470 437		26 635	0	(204)	(0,01)	
	08/2023	\$	393	CNH	2 804	0	(6)	(0,00)	
	08/2023		387	HUF	133 232	0	(3)	(0,00)	
	08/2023		30 171	ZAR	557 665	0	(772)	(0,03)	
	08/2023	ZAR	5 472	\$	285	0	(4)	(0,00)	
	09/2023	ILS	8 181		2 290	79	79	0,00	
	09/2023	MXN	168 876		9 674	0	(30)	(0,00)	
	09/2023	\$	1 958	ILS	7 088	0	(42)	(0,00)	
	09/2023		2 389	PEN	8 763	14	14	0,00	

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	
	09/2023	ZAR	1 341 373	\$ 75 949	\$ 5 434	\$ 0	\$ 5 434	0,20
	10/2023	TRY	2 584	95	0	0	0	0,00
BSH	07/2023	\$	2 380	PEN 8 760	36	0	36	0,00
	08/2023	PEN	7 590	\$ 1 898	0	(188)	(188)	(0,01)
CBK	07/2023	CLP	19 046 146	23 534	0	(184)	(184)	(0,01)
	07/2023	ILS	20 463	5 930	412	0	412	0,02
	07/2023	MXN	36 301	2 098	2	(17)	(15)	0,00
	07/2023	PEN	112 191	30 195	0	(756)	(756)	(0,03)
	07/2023	PHP	218 419	4 004	55	0	55	0,00
	07/2023	PLN	70 879	16 963	0	(468)	(468)	(0,02)
	07/2023	\$	7 410	BRL 35 573	0	(36)	(36)	0,00
	07/2023		6 785	COP 30 960 559	584	0	584	0,02
	07/2023		21 326	CZK 460 457	17	(213)	(196)	(0,01)
	07/2023		4 787	EGP 90 000	0	(1 875)	(1 875)	(0,07)
	07/2023		34 279	PEN 124 593	90	0	90	0,00
	07/2023		5 581	PLN 23 178	119	0	119	0,00
	07/2023		4 797	RON 21 689	0	(28)	(28)	0,00
	07/2023		3 580	UYU 134 341	14	0	14	0,00
	07/2023	UYU	279 852	\$ 7 223	0	(247)	(247)	(0,01)
	08/2023	CAD	1 982	1 487	0	(12)	(12)	0,00
	08/2023	CLP	11 459 287	13 831	0	(403)	(403)	(0,01)
	08/2023	COP	23 471 460	5 551	1	(2)	(1)	0,00
	08/2023	EGP	63 401	1 829	0	(161)	(161)	(0,01)
	08/2023	€	354	381	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	TWD	30 699	1 006	20	0	20	0,00
	08/2023	\$	3 025	BRL 15 357	143	0	143	0,01
	08/2023		71	CNH 494	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023		6 561	€ 6 027	42	(14)	28	0,00
	08/2023		236	MXN 4 084	1	0	1	0,00
	08/2023		780	NOK 8 133	0	(19)	(19)	0,00
	08/2023		2 212	PEN 8 641	163	0	163	0,01
	08/2023	ZAR	197	\$ 11	0	0	0	0,00
	09/2023	COP	4 980 182	1 179	11	0	11	0,00
	09/2023	MXN	146 059	7 841	0	(544)	(544)	(0,02)
	09/2023	PEN	8 040	2 185	0	(20)	(20)	0,00
	09/2023	PHP	617 053	10 952	0	(184)	(184)	(0,01)
	09/2023	\$	53 514	IDR 798 768 556	0	(456)	(456)	(0,02)
	09/2023		24 941	INR 2 067 098	185	0	185	0,01
	09/2023		18 721	PEN 68 649	104	0	104	0,00
	09/2023		6 527	ZAR 119 974	5	(225)	(220)	(0,01)
	09/2023	ZMW	77 599	\$ 4 421	90	0	90	0,00
	10/2023	\$	52 467	CLP 43 001 960	497	0	497	0,02
	10/2023		600	NGN 358 822	0	(155)	(155)	(0,01)
	11/2023	ILS	37 683	\$ 11 421	1 199	0	1 199	0,04
	11/2023	\$	181	EGP 5 845	0	(12)	(12)	0,00
	01/2024	EGP	29 698	\$ 807	0	(6)	(6)	0,00
	02/2024		34 798	926	0	(8)	(8)	0,00
	02/2024	\$	3 165	EGP 110 308	0	(205)	(205)	(0,01)
DUB	07/2023	PEN	216 511	\$ 59 392	0	(323)	(323)	(0,01)
	07/2023	\$	1	KES 118	0	0	0	0,00
	07/2023		29 598	PEN 108 256	267	0	267	0,01
	08/2023	ZAR	139 944	\$ 7 273	0	(105)	(105)	0,00
	09/2023	\$	8 954	ZAR 166 316	119	(330)	(211)	(0,01)
	10/2023		1 500	NGN 885 347	0	(396)	(396)	(0,01)
	11/2023	EGP	14 282	\$ 501	89	0	89	0,00
	01/2024	NGN	384 375	625	166	0	166	0,01
	02/2024	\$	8 159	EGP 286 732	0	(470)	(470)	(0,02)
	04/2024	TRY	2 282	\$ 73	1	0	1	0,00
GLM	07/2023	BRL	225 484	47 187	445	0	445	0,02
	07/2023	COP	21 842 485	4 960	0	(265)	(265)	(0,01)
	07/2023	DOP	1 298 081	22 428	0	(793)	(793)	(0,03)
	07/2023	EGP	287 714	10 325	1 198	(63)	1 135	0,04
	07/2023	PEN	15 492	4 242	0	(29)	(29)	0,00
	07/2023	\$	21 535	BRL 113 559	2 006	0	2 006	0,07
	07/2023		7 456	COP 31 402 811	37	(6)	31	0,00
	07/2023		2 948	EGP 96 843	159	0	159	0,01
	07/2023		39 170	MXN 689 008	935	0	935	0,03
	07/2023		2 747	MYR 12 640	0	(34)	(34)	0,00
	07/2023		1 133	PLN 4 774	41	0	41	0,00
	07/2023		2 792	RON 12 594	0	(23)	(23)	0,00
	08/2023	CHF	180	\$ 204	1	0	1	0,00
	08/2023	CNH	297 572	42 456	1 417	0	1 417	0,05
	08/2023	DOP	1 545 785	27 240	40	(519)	(479)	(0,02)
	08/2023	\$	65 744	BRL 321 506	1 015	(436)	579	0,02
	08/2023		2 665	CNH 18 408	0	(127)	(127)	0,00
	08/2023		343	NOK 3 637	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023		1 847	PEN 6 739	6	0	6	0,00
	08/2023	ZAR	78 924	\$ 4 253	\$ 91	\$ 0	\$ 91	0,00
	09/2023	IDR	62 693 244	4 204	40	0	40	0,00
	09/2023	TRY	225 925	8 834	447	0	447	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	
	09/2023	\$	165 474	BRL 833 635	5 416	0	5 416	0,19
	09/2023		2 395	PEN 8 810	20	0	20	0,00
	09/2023		27 685	THB 955 129	0	(543)	(543)	(0,02)
	10/2023	DOP	359 626	\$ 6 413	37	0	37	0,00
	10/2023	MXN	219 363	12 495	0	(48)	(48)	0,00
	10/2023	NGN	1 735 661	3 097	939	0	939	0,03
	11/2023	DOP	195 976	3 524	76	0	76	0,00
	11/2023	EGP	46 453	1 384	88	(43)	45	0,00
	11/2023	€	12 017	PLN 54 009	21	0	21	0,00
	11/2023	\$	747	EGP 22 633	0	(94)	(94)	0,00
	12/2023	DOP	113 708	\$ 2 042	48	0	48	0,00
	01/2024	EGP	101 314	2 695	0	(78)	(78)	0,00
	01/2024	\$	3 055	EGP 100 557	0	(303)	(303)	(0,01)
	01/2024	ZAR	160 293	\$ 9 119	792	0	792	0,03
HUS	07/2023	EGP	469 250	25 000	9 815	0	9 815	0,34
IND	07/2023	BRL	14 316	\$ 2 896	0	(72)	(72)	0,00
	08/2023	CNH	24 621	3 592	196	0	196	0,01
	08/2023	\$	16 398	€ 15 090	99	0	99	0,00
	08/2023		880	NOK 9 225	0	(18)	(18)	0,00
	09/2023	INR	270 939	\$ 3 296	3	0	3	0,00
	11/2023	€	1 739	HUF 805 467	384	0	384	0,01
	06/2024	\$	7 206	TWD 185 403	0	(1 078)	(1 078)	(0,04)
JPM	07/2023	COP	13 055 307	\$ 2 820	0	(293)	(293)	(0,01)
	07/2023	¥	137 927	964	10	0	10	0,00
	07/2023	MXN	48 989	2 785	0	(66)	(66)	0,00
	07/2023	PHP	14 294	262	3	0	3	0,00
	07/2023	SGD	900	681	16	0	16	0,00
	07/2023	TRY	6 201	238	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	6 716	BRL 33 513	231	0	231	0,01
	07/2023		19 166	MXN 337 899	502	0	502	0,02
	07/2023		449	NGN 246 211	0	(130)	(130)	0,00
	07/2023		265	PLN 1 123	11	0	11	0,00
	07/2023		43 121	RON 195 728	0	(84)	(84)	0,00
	08/2023	CAD	3 259	\$ 2 437	0	(27)	(27)	0,00
	08/2023	CHF	2 913	3 248	4	(26)	(22)	0,00
	08/2023	COP	13 510 737	3 186	0	(22)	(22)	0,00
	08/2023	HUF	9 918 868	28 660	159	(153)	6	0,00
	08/2023	MXN	164 219	9 478	0	(20)	(20)	0,00
	08/2023	\$	44 975	CNY 307 975	0	(2 367)	(2 367)	(0,08)
	08/2023		1 187	EGP 39 726	60	0	60	0,00
	08/2023		210	HUF 71 949	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023		964	¥ 137 341	0	(10)	(10)	0,00
	08/2023		126	NOK 1 341	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023		448	UYU 17 593	18	0	18	0,00
	08/2023		4 345	ZAR 79 525	0	(152)	(152)	(0,01)
	08/2023	UYU	19 861	\$ 500	0	(27)	(27)	0,00
	08/2023	ZAR	185 903	9 566	0	(234)	(234)	(0,01)
	09/2023	COP	2 248 074	532	5	0	5	0,00
	09/2023	IDR	26 138 902	1 741	4	0	4	0,00
	09/2023	ILS	6 826	1 922	77	0	77	0,00
	09/2023	TRY	56 193	2 114	38	0	38	0,00
	09/2023	\$	6 361	INR 523 313	0	0	0	0,00
	09/2023		454	NGN 269 621	0	(113)	(113)	0,00
	09/2023		3 847	THB 132 152	0	(91)	(91)	0,00
	09/2023		11 931	ZAR 233 721	355	0	355	0,01
	10/2023		793	NGN 491 213	0	(184)	(184)	(0,01)
	11/2023	HUF	806 200	€ 1 739	0	(387)	(387)	(0,01)
	12/2023	NGN	421 659	\$ 679	165	0	165	0,01
	12/2023	\$	815	NGN 514 954	0	(186)	(186)	(0,01)
	01/2024	EGP	39 488	\$ 1 071	0	(10)	(10)	0,00
	01/2024	\$	499	EGP 16 406	0	(50)	(50)	0,00
	01/2024		82	NGN 67 814	0	(1)	(1)	0,00
	02/2024	EGP	50 142	\$ 1 323	0	(21)	(21)	0,00
	04/2024	KES	802 538	5 222	0	(77)	(77)	0,00
	04/2024	TRY	267 487	8 535	57	0	57	0,00
	04/2024	\$	2 330	TRY 69 917	0	(114)	(114)	0,00
	06/2024		1 104	IDR 16 560 000	0	(9)	(9)	0,00
	03/2030	IDR	252 540 875	\$ 12 118	0	(2 587)	(2 587)	(0,09)
	03/2030	\$	11 598	IDR 246 110 438	2 733	0	2 733	0,10
MBC	07/2023	£	7 874	\$ 9 747	0	(264)	(264)	(0,01)
	07/2023	SGD	29	22	1	0	1	0,00
	07/2023	\$	1 486	KES 215 400	38	0	38	0,00
	07/2023		108 678	PLN 470 010	6 909	0	6 909	0,25
	08/2023	€	52 236	\$ 57 641	534	0	534	0,02
	08/2023	\$	2 748	CNY 19 365	0	(69)	(69)	0,00
	08/2023		415	COP 1 874 001	30	0	30	0,00
	08/2023	ZAR	92 602	\$ 4 990	109	0	109	0,00
	09/2023	\$	177	KRW 226 123	0	(5)	(5)	0,00
	09/2023		140	THB 4 821	0	(3)	(3)	0,00
	09/2023	ZAR	158 510	\$ 8 762	430	0	430	0,02
	11/2023	€	3 818	PLN 17 159	7	0	7	0,00
	01/2024	\$	992	EGP 32 681	0	(98)	(98)	0,00
MYI	07/2023	CZK	23 199	\$ 1 085	20	0	20	0,00
	07/2023	MXN	90 006	4 996	0	(239)	(239)	(0,01)
	07/2023	PHP	111 680	1 986	0	(33)	(33)	0,00
	07/2023	PLN	2 385	553	0	(34)	(34)	0,00

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	
	07/2023	TRY	222 191	\$ 8 925	\$ 409	\$ 0	\$ 409	0,02
	07/2023	\$	20 488	COP 86 379 722	67	0	67	0,00
	07/2023		3 798	CZK 81 879	0	(41)	(41)	0,00
	07/2023		25 730	EGP 568 058	0	(7 441)	(7 441)	(0,27)
	07/2023		341	MXN 5 968	7	0	7	0,00
	07/2023		11 260	MYR 51 947	4	(114)	(110)	0,00
	07/2023		1 916	PLN 8 066	68	0	68	0,00
	08/2023	€	12 185	\$ 13 211	0	(110)	(110)	0,00
	08/2023	TWD	75 619	2 486	57	0	57	0,00
	08/2023	\$	8 797	€ 8 123	84	0	84	0,00
	08/2023		28	ZAR 520	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	ZAR	302 031	\$ 15 699	0	(223)	(223)	(0,01)
	09/2023	AED	29 573	8 052	0	0	0	0,00
	09/2023	IDR	40 511 883	2 720	29	0	29	0,00
	09/2023	TRY	184 140	6 897	12	0	12	0,00
	09/2023	\$	5 784	IDR 86 351 356	0	(48)	(48)	0,00
	09/2023		253	ILS 906	0	(8)	(8)	0,00
	09/2023		199	KRW 254 127	0	(5)	(5)	0,00
	09/2023		23 034	THB 791 300	0	(548)	(548)	(0,02)
	09/2023		26 211	ZAR 497 154	417	(493)	(76)	0,00
	10/2023	CLP	21 830 145	\$ 26 202	0	(685)	(685)	(0,02)
	10/2023	ZAR	2 449	132	4	0	4	0,00
	11/2023	CZK	203 201	€ 8 500	38	0	38	0,00
	11/2023	EGP	69 353	\$ 1 977	0	(20)	(20)	0,00
	01/2024	NGN	317 955	517	137	0	137	0,01
	01/2024	\$	3 143	EGP 105 605	0	(269)	(269)	(0,01)
	02/2024	EGP	21 106	\$ 563	0	(3)	(3)	0,00
RBC	07/2023	\$	21 849	MXN 420 398	2 621	0	2 621	0,09
	07/2023		2 757	MYR 12 688	0	(34)	(34)	0,00
	08/2023	MXN	1 556 660	\$ 89 825	0	(209)	(209)	(0,01)
	08/2023	\$	2 905	CAD 3 938	73	0	73	0,00
RYL	09/2023		11 222	ZAR 204 941	0	(449)	(449)	(0,02)
SCX	07/2023	€	27	\$ 29	0	0	0	0,00
	07/2023	MYR	32 159	6 997	94	0	94	0,00
	07/2023	NGN	300 933	571	181	0	181	0,01
	07/2023	\$	72	NGN 55 296	0	0	0	0,00
	08/2023	MYR	32 370	\$ 6 970	14	0	14	0,00
	08/2023	NZD	2 493	1 556	29	0	29	0,00
	08/2023	TWD	34 602	1 133	22	0	22	0,00
	08/2023	\$	3 875	BRL 18 906	25	0	25	0,00
	08/2023		19 267	CNH 132 430	0	(1 003)	(1 003)	(0,04)
	09/2023	TWD	49 300	\$ 1 617	31	0	31	0,00
	09/2023	\$	12 605	INR 1 044 968	97	0	97	0,00
	09/2023		1 760	PEN 6 479	18	0	18	0,00
	09/2023		25 207	THB 877 904	0	(259)	(259)	(0,01)
	09/2023		2 166	TRY 49 406	0	(341)	(341)	(0,01)
	09/2023		2 457	ZAR 45 281	0	(77)	(77)	0,00
	10/2023	CLP	21 171 815	\$ 25 389	0	(688)	(688)	(0,02)
	11/2023	EGP	57 399	1 570	0	(83)	(83)	0,00
	11/2023	\$	3 855	EGP 150 553	480	0	480	0,02
	12/2023		2 677	KES 393 738	9	0	9	0,00
	01/2024		1 039	EGP 34 170	0	(104)	(104)	0,00
	01/2024		854	NGN 701 988	0	(15)	(15)	0,00
	02/2024		2 221	EGP 77 297	0	(147)	(147)	(0,01)
	06/2024	KES	411 269	\$ 2 677	0	(7)	(7)	0,00
	03/2030	IDR	239 680 000	10 700	0	(3 257)	(3 257)	(0,12)
SOG	07/2023	\$	2 568	KES 372 407	66	0	66	0,00
	09/2023		240	ZAR 4 538	0	(1)	(1)	0,00
	01/2024		1 697	EGP 55 237	0	(187)	(187)	(0,01)
SSB	07/2023		17 870	BRL 89 763	738	0	738	0,03
	07/2023		23 744	CLP 19 073 452	8	0	8	0,00
	07/2023		30 760	PEN 112 199	176	0	176	0,01
	08/2023	CLP	19 128 537	\$ 23 744	2	0	2	0,00
	08/2023	PEN	112 199	30 717	0	(158)	(158)	(0,01)
	09/2023	\$	4 945	CLP 3 996 762	0	(6)	(6)	0,00
TOR	07/2023	COP	18 477 387	\$ 4 422	26	0	26	0,00
	07/2023	\$	4 422	COP 18 327 934	0	(33)	(33)	0,00
	07/2023		110	CZK 2 354	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023		5 022	£ 3 952	3	0	3	0,00
	07/2023		38 286	PLN 162 267	1 619	0	1 619	0,06
	08/2023	£	3 952	\$ 5 023	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	\$	281	ZAR 5 472	7	0	7	0,00
	08/2023	ZAR	138 447	\$ 7 324	26	0	26	0,00
	09/2023	\$	2 385	ZAR 46 448	59	(2)	57	0,00
UAG	07/2023	COP	9 694 156	\$ 2 325	6	0	6	0,00
	07/2023	PLN	241 738	59 145	0	(304)	(304)	(0,01)
	07/2023	RON	163	35	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	269	CZK 5 856	2	(2)	0	0,00
	07/2023		5 412	MXN 96 367	199	0	199	0,01
	07/2023		2 083	PLN 8 500	7	0	7	0,00
	07/2023		2 663	TRY 61 353	0	(326)	(326)	(0,01)
	08/2023	HUF	1 310 754	\$ 3 761	0	(26)	(26)	0,00
	08/2023	\$	17 186	CNY 118 222	0	(830)	(830)	(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
	08/2023	\$ 2 325	COP 9 768 548	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	08/2023	10	ZAR 196	0	0	0	0,00
	08/2023	ZAR 160 144	\$ 8 558	115	0	115	0,00
	09/2023	ILS 5 908	1 650	54	0	54	0,00
	09/2023	SGD 33 328	24 938	240	0	240	0,01
	09/2023	\$ 2 722	THB 95 047	0	(21)	(21)	0,00
	09/2023	7 246	ZAR 128 361	0	(498)	(498)	(0,02)
	10/2023	5 838	107 241	0	(217)	(217)	(0,01)
	11/2023	CZK 316 478	€ 12 958	0	(248)	(248)	(0,01)
	11/2023	ILS 6 376	\$ 1 844	114	0	114	0,00
	04/2024	\$ 6 557	TRY 198 196	0	(275)	(275)	(0,01)
				\$ 64 649	\$ (50 035)	\$ 14 614	0,52

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 31 042 1,11

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CERTIFICATS DE DÉPÔT			
Banco Davivienda S.A.			
13,501 % éch. 13/12/2024	COP 12 258 000	\$ 2 935	0,10
15,389 % éch. 21/02/2024	3 100 500	753	0,03
Bancolombia S.A.			
5,917 % éch. 27/01/2024	14 430 300	3 326	0,12
13,320 % éch. 08/06/2025	6 362 000	1 529	0,05
13,637 % éch. 14/12/2024	17 049 000	4 106	0,15
16,137 % éch. 01/09/2024	6 849 000	1 659	0,06
BBVA Colombia S.A.			
5,870 % éch. 15/07/2024	14 375 000	3 234	0,12
14,540 % éch. 13/01/2024	6 028 200	1 432	0,05
16,412 % éch. 25/04/2024	225 000	53	0,00
Total des Certificats de dépôt		\$ 19 027	0,68
Total des Investissements		\$ 2 852 494	102,41
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (67 051)	(2,41)
Actifs nets		\$ 2 785 443	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) Titres 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 : 0,76 %) :

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	11 513	0,41
DrillCo Holding Lux S.A.	08/06/2023	158	151	0,01
Flourish Century 6,600 % éch. 04/02/2022	25/08/2021	2 759	310	0,01
		\$ 17 819	\$ 12 015	0,43

(k) Des titres d'une juste valeur globale de 153 171 \$ (31 décembre 2022 : 86 429 \$) et un montant en numéraire de 3 296 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 285 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 25 147 \$ (31 décembre 2022 : 21 557 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 17 830 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 2023.

Tableau des investissements Fonds Emerging Local 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 30 juin 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	\$	2 405 489	\$	143 534	\$ 2 549 023
Fonds d'investissement		269 736		0		0	269 736
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾		101		14 259		348	14 708
Dépôts auprès d'établissements de crédit		0		5 576		13 451	19 027
Totaux	\$	269 837	\$	2 425 324	\$	157 333	\$ 2 852 494

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 30 juin 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	7,000 %	12/12/2022	TBD ⁽¹⁾	PLN (197 832)	\$	(50 507)	(1,81)
		16/03/2023	TBD ⁽¹⁾	(91 297)		(22 921)	(0,82)
JML	4,700	29/06/2023	TBD ⁽¹⁾	\$	(6 862)	(6 864)	(0,25)
MBC	8,750	15/06/2023	06/07/2023	ZAR (241 488)		(12 833)	(0,46)
	8,850	15/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(621 035)		(33 007)	(1,19)
SCX	8,700	23/03/2023	TBD ⁽¹⁾	(441 680)		(23 881)	(0,86)
Total des contrats de prise en pension					\$	(150 013)	(5,39)

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 3 256	\$ (3 010)	\$ 246	\$ 13 050	\$ (12 520)	\$ 530
BPS	(57)	690	633	(16 890)	15 580	(1 310)
BRC	4 184	(3 420)	764	(1 554)	1 440	(114)
BSH	(885)	0	(885)	(1 101)	0	(1 101)
BSS	0	890	890	0	920	920
CBK	(1 093)	1 340	247	6 571	(6 325)	246
CKL	(271)	0	(271)	(265)	0	(265)
CLY	S/O	S/O	S/O	2 606	0	2 606
DUB	(23)	(220)	(243)	50	0	50
GLM	21 067	(18 700)	2 367	10 551	(10 070)	481
GST	746	(780)	(34)	(180)	190	10
HUS	8 011	(7 910)	101	6 780	(6 910)	(130)
IND	(486)	440	(46)	(46)	(1 510)	(2 344)
JPM	(836)	650	(186)	1 710	(1 280)	430
MBC	7 619	(7 270)	349	5 248	(4 930)	318
MYC	(118)	0	(118)	(365)	410	45
MYI	(7 841)	8 050	209	(4 865)	3 730	(1 135)
RBC	2 467	(2 320)	147	(4 253)	4 420	167
RYL	(449)	290	(159)	274	(260)	14
SCX	(4 981)	4 200	(781)	1 418	(1 120)	298
SOG	(122)	210	88	(587)	590	3
SSB	760	(830)	(70)	(924)	1 040	116
TOR	1 702	(1 280)	422	309	(270)	39
UAG	(1 608)	1 070	(538)	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	72,29	63,67
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	19,22	27,35
Autres valeurs mobilières	0,01	1,33
Fonds d'investissement	9,68	6,86
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,01	0,04
Instruments financiers dérivés compensés	(0,59)	(1,03)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,11	1,10
Certificats de dépôt	0,68	0,37
Contrats de prise en pension	(5,39)	(4,45)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Argentine	0,01	0,16
Azerbaïdjan	0,10	0,23
Bahamas	S/O	0,13
Bésil	3,24	4,48
Îles Caïmans	0,26	0,44
Chili	3,01	2,06
Chine	5,37	5,74
Colombie	3,67	3,65
République tchèque	3,39	2,89
Danemark	0,00	0,00
République dominicaine	2,69	1,30
Hongrie	1,97	0,40
Indonésie	6,13	5,26
Internationales	0,58	S/O
Irlande	0,58	0,83
Israël	0,80	1,75
Côte d'Ivoire	0,24	0,38
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,28	0,51
Kazakhstan	S/O	0,05
Luxembourg	0,02	0,01
Malaisie	10,11	9,11
Mexique	10,23	8,11
Pays-Bas	0,07	0,20
Nigeria	0,12	0,22
Pérou	3,64	2,32
Philippines	0,10	0,04
Pologne	5,16	4,79
Qatar	0,66	0,92
Roumanie	2,06	3,99
Russie	0,18	0,26
Serbie	0,11	0,15
Afrique du Sud	11,58	13,70
Corée du Sud	0,35	0,18
Supranationales	0,93	0,37
Tanzanie	0,32	0,49
Thaïlande	6,34	4,23
Turquie	0,38	0,53
Émirats arabes unis	1,17	1,60
Royaume-Uni	0,29	0,58
États-Unis	1,97	2,50
Uruguay	0,40	S/O
Îles Vierges britanniques	S/O	0,31
Zambie	0,18	S/O
Instruments à court terme	2,83	7,48
Fonds d'investissement	9,68	6,86
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,01	0,04
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	(0,59)	(1,03)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	0,28	0,13
Options doubles (Straddle)	0,00	S/O
Options vendues		
Options de change	(0,08)	(0,01)
Swaps de taux d'intérêt	(0,01)	(0,01)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,04	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	(0,14)
Swaps sur devises croisées	0,30	0,42
Swaps de taux d'intérêt	0,06	0,19
Swaps de volatilité	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,52	0,52
Certificats de dépôt	0,68	0,37
Autres actifs et passifs à court terme	(2,41)	0,31
Actifs nets	100,00	100,00

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	CDI BRL à 1 an	11,200 %	04/01/2027	BRL 400	\$ (2)	(0,03)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,244	02/01/2026	500	(2)	(0,03)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,380	04/01/2027	100	(1)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,400	04/01/2027	250	1	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,410	04/01/2027	250	1	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,420	02/01/2026	600	3	0,03
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,445	02/01/2025	300	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,515	02/01/2025	400	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,540	02/01/2024	2 700	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,725	02/01/2025	1 500	0	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,734	02/01/2025	200	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,740	02/01/2025	100	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,750	02/01/2025	100	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,800	02/01/2025	300	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,810	02/01/2025	400	1	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,835	02/01/2025	300	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,845	02/01/2025	600	0	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,870	02/01/2025	500	0	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,905	04/01/2027	200	(2)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,005	02/01/2025	500	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,090	02/01/2025	400	(1)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,090	04/01/2027	300	3	0,03
À payer	CDI BRL à 1 an	12,091	04/01/2027	200	2	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	12,210	02/01/2025	300	0	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,350	01/07/2024	900	0	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,490	01/07/2024	900	(1)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,533	02/01/2029	300	(5)	(0,05)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,595	01/07/2024	900	1	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	12,684	02/01/2029	300	4	0,05
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,740	02/01/2025	300	(1)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,746	02/01/2029	300	4	0,06
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,765	02/01/2025	100	0	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	13,080	02/01/2024	3 400	5	0,05
À payer	CDI BRL à 1 an	13,080	01/07/2024	1 800	4	0,05
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,190	02/01/2025	200	(1)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,215	02/01/2025	100	(1)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,218	02/01/2029	700	(13)	(0,16)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,400	02/01/2025	400	(2)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	13,995	02/01/2024	900	1	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,190	13/06/2029	COP 180 300	1	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,305	28/04/2028	124 600	1	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,390	13/06/2028	65 600	0	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,495	27/04/2030	40 000	0	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,950	24/03/2030	130 000	(2)	(0,03)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,040	05/05/2030	1 200	0	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,300	26/03/2031	136 900	(5)	(0,05)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,370	17/03/2030	47 800	(1)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,393	21/03/2030	111 700	(3)	(0,04)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,410	26/03/2031	123 400	(3)	(0,04)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,423	17/03/2030	141 500	(4)	(0,04)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,930	07/03/2033	34 420	(1)	(0,02)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,400	21/11/2029	18 300	(1)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,500	21/03/2025	614 100	2	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,550	17/03/2025	43 090	0	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,353	15/11/2027	151 660	6	0,06
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,000	26/11/2025	124 890	(2)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,070	26/11/2025	128 000	(2)	(0,03)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2033	KRW 218 574	(2)	(0,03)
À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	15/03/2028	THB 4 530	0	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,120	13/03/2028	ZAR 300	0	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,830	23/02/2030	600	0	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	10,150	18/05/2033	300	1	0,01
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	5,770	21/11/2027	28 300	(1)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,070	28/02/2028	55 800	(2)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	01/10/2028	3 800	1	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,195	01/10/2028	2 100	0	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,611	06/06/2028	CZK 9 600	(2)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	€ 100	(1)	(0,02)
À payer	BBR HUF à 6 mois	10,570	22/08/2027	HUF 4 800	2	0,02
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,220	20/03/2033	PLN 100	0	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,295	25/01/2028	1 850	(1)	(0,02)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,520	20/03/2026	300	0	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,870	22/04/2027	200	2	0,03
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,830	19/08/2024	100	(1)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,890	22/08/2024	300	(3)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,207	19/06/2028	MXN 600	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,300	16/06/2028	1 200	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,438	20/03/2028	700	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,448	27/04/2028	400	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,450	27/04/2028	900	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,560	18/05/2028	300	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	TIE MXN à 28 jours	8,585 %	18/05/2028	MXN 300	\$ 0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,600	18/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,610	18/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,645	18/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,656	18/05/2028	200	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,720	19/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,722	19/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,755	19/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,762	13/04/2028	2 300	(2)	(0,03)
					\$ (12)	(0,16)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (12)	(0,16)

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 de vente - EUR contre CZK hors cote	CZK 23,830	01/11/2023	8	\$ 1	\$ 3	0,05
GLM	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF 385,000	01/11/2023	3	0	2	0,02
	Option de vente - EUR contre PLN hors cote	PLN 4,560	01/11/2023	6	1	5	0,06
MYI	Option de vente - USD contre BRL hors cote	BRL 4,820	22/08/2023	70	1	1	0,01
	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN 18,500	25/07/2023	71	2	6	0,07
RBC	Option de vente - USD contre CAD hors cote	CAD 1,305	13/07/2023	71	0	0	0,00
UAG	Option d'achat - EUR contre USD hors cote	\$ 1,140	13/07/2023	64	0	1	0,00
	Option d'achat - USD contre ZAR hors cote	ZAR 20,500	09/10/2023	112	2	1	0,02
					\$ 7	\$ 18	0,23

OPTIONS DOUBLES (STRADDLE)

Contrepartie	Description	Niveau d'exercice ⁽²⁾	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Coût ⁽²⁾	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600 %	27/12/2023	100	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	15,100	20/12/2023	100	0	0	0,00
MYI	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600	27/12/2023	50	0	0	0,00
					\$ 0	\$ 0	0,00

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
JPM	Option d'achat - USD contre INR hors cote	IDR 14 950,000	06/06/2024	21	\$ (1)	\$ (1)	(0,01)
	Option de vente - USD contre INR hors cote	14 950,000	06/06/2024	21	(1)	(1)	(0,01)
MYI	Option d'achat - USD contre CLP hors cote	CLP 850,000	18/07/2023	41	(1)	0	0,00
	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN 17,750	25/07/2023	142	(1)	(4)	(0,05)
	Option d'achat - USD contre MXN hors cote	21,000	07/03/2024	67	0	0	(0,01)
					\$ (4)	\$ (6)	(0,08)

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

(2) Niveau d'exercice et coût final déterminés à une date future sur la base des paramètres implicites de volatilité.

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 turc	(1,000) %	20/06/2024	\$ 100	\$ 3	\$ (2)	\$ 1	0,01

(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.

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 %	15/03/2028	MYR 10	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	770	(2)	1	(1)	(0,01)
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,545	05/05/2028	308	0	1	1	0,01
						\$ (2)	\$ 2	\$ 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	07/2023	CZK	5 325	\$ 245	\$ 1	\$ 0	0,01		
	07/2023	PHP	1 932	35	0	0	0,00		
	07/2023	PLN	15	4	0	0	0,00		
	07/2023	\$	136	ILS 490	0	(5)	(5)	(0,06)	
	08/2023	MXN	470	\$ 25	0	(2)	(2)	(0,02)	
	08/2023	NZD	20	13	0	0	0	0,01	
	08/2023	\$	2	EGP 82	0	0	0	0,00	
	08/2023		24	€ 22	0	0	0	0,00	
	08/2023		141	ILS 489	0	(10)	(10)	(0,12)	
	08/2023	ZAR	454	\$ 24	0	0	0	0,00	
	09/2023	\$	9	CLP 7 227	0	0	0	0,00	
	09/2023		35	MYR 160	0	0	0	(0,01)	
	09/2023		26	THB 906	0	(1)	(1)	(0,01)	
	09/2023		47	TWD 1 438	0	(1)	(1)	(0,01)	
	10/2023	ZAR	297	\$ 16	0	0	0	0,01	
	11/2023	€	49	CZK 1 206	1	0	1	0,01	
	BPS	07/2023	BRL	280	\$ 57	0	(1)	(1)	(0,01)
		07/2023	MYR	52	11	0	0	0	0,00
		07/2023	\$	32	BRL 158	1	0	1	0,01
		07/2023		9	CZK 189	0	0	0	0,00
07/2023			92	MYR 423	0	(1)	(1)	(0,02)	
07/2023			49	PHP 2 755	1	0	1	0,01	
07/2023			11	RON 51	0	0	0	0,00	
07/2023			29	SGD 39	0	0	0	(0,01)	
08/2023		CLP	67 282	\$ 82	0	(2)	(2)	(0,03)	
08/2023		MXN	4 241	244	0	(2)	(2)	(0,02)	
08/2023		MYR	507	109	0	0	0	0,00	
08/2023		\$	22	COP 98 915	1	0	1	0,02	
08/2023			11	€ 10	0	0	0	0,00	
08/2023			24	TWD 720	0	0	0	(0,01)	
08/2023		ZAR	238	\$ 13	0	0	0	0,00	
09/2023		PHP	4 716	84	0	(1)	(1)	(0,02)	
09/2023		\$	7	CLP 5 724	0	0	0	0,00	
09/2023			11	IDR 163 593	0	0	0	0,00	
09/2023			8	INR 658	0	0	0	0,00	
09/2023			41	THB 1 421	0	(1)	(1)	(0,01)	
BRC	12/2023	MXN	143	\$ 8	0	0	0,00		
	07/2023	PHP	75	1	0	0	0,00		
	07/2023	PLN	16	4	0	0	0,00		
	07/2023	SGD	53	40	1	0	1	0,01	
	07/2023	\$	45	MYR 207	0	0	0	(0,01)	
	07/2023		7	PHP 391	0	0	0	0,00	
	07/2023		18	PLN 73	0	0	0	0,00	
	07/2023		14	RON 64	0	0	0	0,00	
	08/2023	COP	750 524	\$ 176	0	(1)	(1)	(0,02)	
	08/2023	\$	5	£ 4	0	0	0	0,00	
	08/2023		12	HUF 4 164	0	0	0	0,00	
	08/2023		65	¥ 8 553	0	(6)	(6)	(0,07)	
	09/2023		1	ILS 4	0	0	0	0,00	
	09/2023		11	MXN 183	0	0	0	0,00	
	09/2023		40	PEN 147	0	0	0	0,00	
	10/2023	MXN	1 202	\$ 64	0	(6)	(6)	(0,06)	
	10/2023	TRY	189	7	0	0	0	0,00	
	CBK	07/2023	BRL	58	12	0	0	0,00	
		07/2023	CLP	47 605	59	0	0	(0,01)	
		07/2023	COP	30 503	7	0	(1)	(1)	(0,01)
07/2023		ILS	688	209	24	0	24	0,30	
07/2023		MXN	5 000	260	0	(32)	(32)	(0,41)	
07/2023		PHP	1 140	21	0	0	0	0,00	
07/2023		PLN	194	46	0	(2)	(2)	(0,02)	
07/2023		\$	32	BRL 153	0	0	0	0,00	
07/2023			31	COP 138 941	4	0	4	0,03	
07/2023			8	CZK 174	0	0	0	0,00	
07/2023			57	MXN 1 005	2	0	2	0,03	
07/2023			29	PEN 105	0	0	0	0,00	
07/2023			29	PLN 119	0	0	0	0,01	
07/2023			80	UYU 2 993	1	0	1	0,01	
07/2023		UYU	5 812	\$ 150	0	(6)	(6)	(0,06)	
08/2023	BRL	319	62	0	(5)	(5)	(0,05)		

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
	08/2023	CAD	6	\$ 5	\$ 0	\$ 0	0,00
	08/2023	COP	63 876	15	0	0	0,00
	08/2023	EGP	82	2	0	0	0,00
	08/2023	ILS	491	152	21	0	0,26
	08/2023	¥	9 700	71	5	0	0,05
	08/2023	PEN	6	1	0	0	0,00
	08/2023	\$	12	BRL 58	0	0	0,00
	08/2023		81	CLP 67 282	2	0	0,03
	08/2023		62	€ 57	0	0	0,01
	08/2023		7	¥ 1 000	0	0	(0,01)
	08/2023		3	NOK 31	0	0	0,00
	08/2023		25	TWD 750	0	0	(0,01)
	08/2023		23	ZAR 418	0	(1)	(0,01)
	09/2023	COP	14 111	\$ 3	0	0	0,00
	09/2023	PEN	363	99	0	0	0,00
	09/2023	\$	13	IDR 201 090	0	0	0,00
	09/2023		36	INR 2 955	0	0	0,00
	09/2023		10	THB 343	0	0	0,00
	11/2023	ILS	98	\$ 29	4	4	0,04
	11/2023	\$	35	EGP 1 145	0	(2)	(0,03)
	02/2024	EGP	295	\$ 8	0	0	0,00
	02/2024	\$	42	EGP 1 468	0	(3)	(0,03)
GLM	07/2023	BRL	2 459	\$ 509	0	0	(0,01)
	07/2023	COP	20 469	5	0	0	0,00
	07/2023	DOP	4 044	70	0	(2)	(0,03)
	07/2023	ILS	196	58	6	0	0,07
	07/2023	PEN	67	18	0	0	0,00
	07/2023	PLN	36	8	0	0	(0,01)
	07/2023	\$	430	BRL 2 305	49	0	0,63
	07/2023		2	COP 8 480	0	0	0,00
	07/2023		31	CZK 667	0	0	(0,01)
	07/2023		7	DOP 394	0	0	0,00
	07/2023		203	MXN 3 554	5	0	0,06
	07/2023		13	MYR 60	0	0	0,00
	07/2023		16	RON 70	0	0	0,00
	07/2023		79	SGD 104	0	(1)	(0,02)
	08/2023	BRL	28	\$ 6	0	0	0,00
	08/2023	DOP	1 127	20	0	0	0,00
	08/2023	\$	115	HUF 39 111	0	(2)	(0,02)
	08/2023		4	NOK 39	0	0	0,00
	08/2023		9	PEN 33	0	0	0,00
	08/2023	ZAR	191	\$ 10	0	0	0,00
	09/2023	TRY	608	24	1	0	0,02
	09/2023	TWD	1 060	35	1	0	0,01
	09/2023	\$	509	BRL 2 486	0	0	0,01
	09/2023		5	COP 21 367	0	0	0,00
	09/2023		9	PEN 34	0	0	0,00
	09/2023		75	THB 2 581	0	(1)	(0,02)
	10/2023	DOP	1 459	\$ 26	0	0	0,00
	11/2023	CZK	1 206	€ 49	0	(1)	(0,01)
	11/2023	DOP	170	\$ 3	0	0	0,00
	11/2023	EGP	1 534	51	8	0	0,09
	11/2023	€	46	PLN 206	0	0	0,00
	11/2023	\$	2	EGP 75	0	0	0,00
	12/2023	DOP	223	\$ 4	0	0	0,00
	01/2024	EGP	761	20	0	0	0,00
	01/2024	\$	10	EGP 329	0	(1)	(0,01)
	01/2024	ZAR	599	\$ 34	3	0	0,04
JPM	07/2023	RON	203	44	0	(1)	(0,01)
	07/2023	TRY	455	17	0	0	0,00
	07/2023	\$	15	BRL 75	1	0	0,01
	07/2023		33	MXN 567	0	0	0,00
	08/2023	CAD	11	\$ 8	0	0	0,00
	08/2023	CHF	8	9	0	0	0,00
	08/2023	COP	36 076	9	0	0	0,00
	08/2023	€	25	28	0	0	0,00
	08/2023	£	6	8	0	0	0,00
	08/2023	\$	9	BRL 44	0	0	0,00
	08/2023		10	£ 8	0	0	0,00
	08/2023		170	HUF 59 239	1	0	0,02
	08/2023		11	¥ 1 406	0	(1)	(0,01)
	08/2023		1	NOK 14	0	0	0,00
	08/2023		4	UYU 163	0	0	0,00
	08/2023	ZAR	520	\$ 27	0	(1)	(0,01)
	09/2023	IDR	392 787	26	0	0	0,00
	09/2023	PEN	266	72	0	(1)	(0,01)
	09/2023	\$	1	ILS 3	0	0	0,00
	09/2023		9	INR 740	0	0	0,00
	09/2023		3	PEN 12	0	0	0,00
	09/2023		20	THB 691	0	0	(0,01)
	01/2024	EGP	147	\$ 4	0	0	0,00
	04/2024	TRY	533	17	0	0	0,00
	06/2024	\$	3	IDR 45 000	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	
MBC	07/2023	PLN	633	\$ 147	\$ 0	\$ (10)	(0,11)	
	07/2023	\$	10	MXN 174	0	0	0,00	
	07/2023		155	RON 703	0	0	0,00	
	08/2023		9	ZAR 172	0	0	0,00	
	09/2023		10	COP 42 586	0	0	0,00	
	09/2023		1	THB 25	0	0	0,00	
	01/2024		4	EGP 125	0	0	0,00	
MYI	07/2023	CZK	409	\$ 19	0	0	0,00	
	07/2023	MXN	228	13	0	(1)	(0,01)	
	07/2023	PLN	35	8	0	0	0,00	
	07/2023	\$	68	COP 286 653	0	0	0,00	
	07/2023		112	ILS 393	0	(7)	(0,08)	
	07/2023		29	MYR 134	0	0	0,00	
	07/2023		16	PLN 67	0	0	0,01	
	08/2023	€	37	\$ 40	0	0	0,00	
	08/2023	TWD	3	0	0	0	0,00	
	08/2023	\$	24	€ 22	0	0	0,00	
	08/2023		106	MXN 1 834	0	0	0,00	
	08/2023		26	TWD 775	0	(1)	(0,01)	
	08/2023	ZAR	75	\$ 4	0	0	0,00	
	09/2023	IDR	100 437	7	0	0	0,00	
	09/2023	\$	30	IDR 449 763	0	0	0,00	
	09/2023		102	THB 3 509	0	(3)	(0,03)	
	01/2024	EGP	21	\$ 1	0	0	0,00	
	01/2024	\$	11	EGP 356	0	(1)	(0,01)	
	02/2024	EGP	157	\$ 4	0	0	0,00	
RYL	11/2023	\$	28	ILS 98	0	(1)	(0,01)	
SCX	07/2023	TRY	171	\$ 7	1	0	0,01	
	07/2023	\$	92	MYR 425	0	(1)	(0,02)	
	08/2023	NZD	7	\$ 4	0	0	0,00	
	09/2023	\$	13	CLP 10 486	0	0	0,00	
	09/2023		68	INR 5 614	1	0	0,01	
	09/2023		10	PEN 38	0	0	0,00	
	09/2023		39	TWD 1 202	0	(1)	(0,01)	
	11/2023	EGP	110	\$ 3	0	0	0,00	
	11/2023	\$	10	EGP 387	1	0	0,02	
	01/2024		0	7	0	0	0,00	
	02/2024	EGP	188	\$ 5	0	0	0,00	
SSB	07/2023	\$	59	CLP 47 673	0	0	0,00	
	08/2023	CLP	47 810	\$ 59	0	0	0,00	
	09/2023	\$	20	BRL 102	1	0	0,01	
UAG	07/2023	COP	8 537	\$ 2	0	0	0,00	
	07/2023	\$	22	BRL 107	0	0	0,00	
	07/2023		163	CZK 3 578	1	0	0,02	
	07/2023		8	PLN 32	0	0	0,00	
	07/2023		9	RON 40	0	0	0,00	
	08/2023		9	CAD 12	0	0	0,00	
	08/2023		2	COP 8 603	0	0	0,00	
	08/2023	ZAR	9	160	0	0	0,00	
	08/2023	ZAR	711	\$ 38	0	0	0,00	
	09/2023	SGD	94	70	1	0	0,01	
	09/2023	\$	1	ILS 3	0	0	0,00	
	09/2023		6	THB 216	0	0	0,00	
	10/2023		16	ZAR 294	0	(1)	(0,01)	
	04/2024		18	TRY 544	0	(1)	(0,01)	
					\$ 150	\$ (132)	\$ 18	0,24

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 31 0,40

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CERTIFICATS DE DÉPÔT			
Banco Davivienda S.A. 13,501 % éch. 13/12/2024 15,389 % éch. 21/02/2024	COP 33 000 9 500	\$ 8 2	0,10 0,03
BancoLombia S.A. 5,917 % éch. 27/01/2024 13,320 % éch. 08/06/2025 13,637 % éch. 14/12/2024 16,137 % éch. 01/09/2024	 46 200 17 000 47 000 18 000	 11 4 11 4	0,14 0,05 0,14 0,05
BBVA Colombia S.A. 5,870 % éch. 15/07/2024 14,540 % éch. 13/01/2024	 39 000 18 800	 9 5	0,12 0,07
Total des Certificats de dépôt		\$ 54	0,70
Total des Investissements		\$ 7 653	99,49
Autres actifs et passifs à court terme		\$ 39	0,51
Actifs nets		\$ 7 692	100,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond 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) Un titre d'une juste valeur globale de 39 143 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 60 \$ (31 décembre 2022 : 39 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 7 580	\$ 0	\$ 7 580
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	0	19	0	19
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	18	36	54
Totaux	\$ 0	\$ 7 617	\$ 36	\$ 7 653

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	\$ 6 270	\$ 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.

Contrats de prise en pension au 30 juin 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	14,700 %	22/05/2023	TBD ⁽¹⁾	HUF (36 928)	\$ (110)	(1,43)
Total des contrats de prise en pension					\$ (110)	(1,43)

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ (15)	\$ 0	\$ (15)	\$ 3	\$ 0	\$ 3
BPS	(5)	0	(5)	S/O	S/O	S/O
BRC	(12)	0	(12)	33	0	33
CBK	11	0	11	26	0	26
GLM	73	(60)	13	30	0	30
GST	1	0	1	S/O	S/O	S/O
JPM	(4)	0	(4)	S/O	S/O	S/O
MBC	(10)	0	(10)	S/O	S/O	S/O
MYI	(10)	0	(10)	(2)	0	(2)
RYL	(1)	0	(1)	S/O	S/O	S/O
SCX	1	0	1	(35)	0	(35)
SSB	1	0	1	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	85,31	69,10
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	13,24	24,21
Autres valeurs mobilières	S/O	1,57
Instruments financiers dérivés compensés	(0,16)	(0,02)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,40	0,83
Certificats de dépôt	0,70	0,06
Contrats de prise en pension	(1,43)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Chili	3,27	2,02
Colombie	3,86	3,54
République tchèque	8,65	6,84
République dominicaine	1,73	0,23
Allemagne	2,92	1,45
Hongrie	2,77	2,17
Indonésie	5,23	5,33
Israël	S/O	2,52
Malaisie	9,65	8,58
Mexique	8,10	5,26
Pérou	4,51	2,20
Pologne	5,13	2,47
Roumanie	2,62	4,38
Afrique du Sud	6,66	10,65
Supranationales	19,14	14,91
Thaïlande	6,66	4,28
Uruguay	1,19	1,12
Instruments à court terme	6,46	16,93
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de taux d'intérêt	(0,16)	(0,02)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	0,23	0,09
Options doubles (Straddle)	0,00	S/O
Options vendues		
Options de change	(0,08)	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,01	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	S/O	(0,09)
Swaps de taux d'intérêt	0,00	S/O
Swaps de volatilité	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,24	0,83
Certificats de dépôt	0,70	0,06
Autres actifs et passifs à court terme	0,51	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
VALEURS MOBILIÈRES			
ALBANIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement albanais			
3,500 % éch. 23/11/2031	€ 3 500	\$ 3 189	0,09
ANGOLA			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement angolais			
8,250 % éch. 09/05/2028	\$ 15 400	13 703	0,40
8,750 % éch. 14/04/2032	300	253	0,01
9,500 % éch. 12/11/2025	400	392	0,01
Total Angola		14 348	0,42
ARGENTINE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement argentin			
0,500 % éch. 09/07/2030	32 362	10 807	0,32
1,000 % éch. 09/07/2029	13 237	4 328	0,13
1,500 % éch. 09/07/2035	49 867	15 040	0,44
3,500 % éch. 09/07/2041	48 955	15 764	0,46
3,875 % éch. 09/01/2038	36 056	12 742	0,38
Provincia de Buenos Aires			
5,250 % éch. 01/09/2037	5 000	1 919	0,06
Provincia de Cordoba			
6,875 % éch. 10/12/2025 ^	1 909	1 441	0,04
Provincia de la Rioja			
6,500 % éch. 24/02/2028 ^	6 321	3 381	0,10
Provincia de Neuquen			
6,625 % éch. 27/04/2030 ^	2 210	1 570	0,05
Total Argentine		66 992	1,98
AZERBAÏDJAN			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC			
7,230 % éch. 17/03/2026	12 500	12 219	0,36
Southern Gas Corridor CJSC			
6,875 % éch. 24/03/2026	25 700	26 152	0,77
		38 371	1,13
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement azerbaïdjanais			
4,750 % éch. 18/03/2024	908	899	0,03
Total Azerbaïdjan		39 270	1,16
BAHAMAS			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement des Bahamas			
6,000 % éch. 21/11/2028	14 900	12 032	0,36
BAHREÏN			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement bahreïni			
4,250 % éch. 25/01/2028	11 500	10 636	0,31
5,625 % éch. 30/09/2031	700	649	0,02
Total Bahreïn		11 285	0,33
BENIN			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement du Bénin			
4,875 % éch. 19/01/2032	€ 4 150	3 447	0,10
BRÉSIL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco do Brasil S.A.			
3,250 % éch. 30/09/2026	\$ 2 700	2 492	0,07
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais			
5,333 % éch. 15/02/2028	21 945	21 556	0,64
CSN Inova Ventures			
6,750 % éch. 28/01/2028	15 800	14 673	0,43
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.			
0,000 % éch. 31/07/2023 (d)(e)	14 563	38	0,00
Vale S.A.			
0,000 % (e)	BRL 188 860	12 039	0,36
		50 798	1,50

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement brésilien			
4,750 % éch. 14/01/2050	\$ 4 700	3 472	0,10
Total Brésil		54 270	1,60
CAMEROUN			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement de la République du Cameroun			
5,950 % éch. 07/07/2032	€ 7 600	5 998	0,18
CANADA			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Frontera Energy Corp.			
7,875 % éch. 21/06/2028	\$ 1 300	949	0,03
ÎLES CAÏMANS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AAC Technologies Holdings, Inc.			
2,625 % éch. 02/06/2026	4 600	4 032	0,12
Bioceano Sovereign Certificate Ltd.			
0,000 % éch. 05/06/2034 (d)	12 735	8 912	0,26
Country Garden Holdings Co. Ltd.			
2,700 % éch. 12/07/2026	500	153	0,00
3,125 % éch. 22/10/2025	400	126	0,00
5,400 % éch. 27/05/2025	1 300	481	0,01
6,150 % éch. 17/09/2025	900	297	0,01
Gaci First Investment Co.			
4,875 % éch. 14/02/2035	1 300	1 248	0,04
5,000 % éch. 13/10/2027	22 200	22 131	0,65
5,125 % éch. 14/02/2053	15 600	14 060	0,42
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.			
6,250 % éch. 15/02/2025	500	429	0,01
ICD Funding Ltd.			
3,223 % éch. 28/04/2026	1 830	1 710	0,05
Interoceania Finance Ltd.			
0,000 % éch. 30/11/2025 (d)	573	528	0,02
0,000 % éch. 15/05/2030 (d)	6 563	4 884	0,14
7,860 % éch. 15/05/2030	3 543	3 365	0,10
Kaisa Group Holdings Ltd.			
8,500 % éch. 30/06/2022 ^	600	40	0,00
9,375 % éch. 30/06/2024 ^	4 100	273	0,01
9,750 % éch. 28/09/2023 ^	3 200	214	0,01
11,250 % éch. 09/04/2022 ^	1 100	74	0,00
11,500 % éch. 30/01/2023 ^	200	13	0,00
11,700 % éch. 11/11/2025 ^	3 300	221	0,01
11,950 % éch. 12/11/2023 ^	2 600	211	0,01
KSA Sukuk Ltd.			
5,268 % éch. 25/10/2028	12 300	12 575	0,37
Lima Metro Line Finance Ltd.			
4,350 % éch. 05/04/2036	360	319	0,01
5,875 % éch. 05/07/2034	1 037	1 009	0,03
New Metro Global Ltd.			
4,500 % éch. 02/05/2026	3 400	1 437	0,04
6,800 % éch. 05/08/2023	200	195	0,01
Nogaholding Sukuk Ltd.			
6,625 % éch. 25/05/2033	3 700	3 699	0,11
Poinsettia Finance Ltd.			
6,625 % éch. 17/06/2031	12 125	10 020	0,30
Seazen Group Ltd.			
4,450 % éch. 13/07/2025	3 500	1 820	0,05
Sunac China Holdings Ltd.			
6,500 % éch. 10/01/2025 ^	8 500	1 285	0,04
7,000 % éch. 09/07/2025 ^	4 700	711	0,02
7,250 % éch. 14/06/2022 ^	900	134	0,00
Tencent Holdings Ltd.			
3,840 % éch. 22/04/2051	200	147	0,00
Zhongsheng Group Holdings Ltd.			
3,000 % éch. 13/01/2026	3 900	3 557	0,11
Total Îles Caïmans		100 310	2,96
CHILI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco del Estado de Chile			
2,704 % éch. 09/01/2025	\$ 4 300	4 116	0,12
Banco Santander Chile			
2,700 % éch. 10/01/2025	5 200	4 977	0,15
Corp. Nacional del Cobre de Chile			
3,625 % éch. 01/08/2027	6 700	6 331	0,19

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,500 % éch. 01/08/2047	\$ 3 200	2 734	0,08
4,875 % éch. 04/11/2044 (i)	5 600	5 062	0,15
5,125 % éch. 02/02/2033	2 800	2 764	0,08
6,150 % éch. 24/10/2036	1 000	1 088	0,03
Embotelladora Andina S.A.			
3,950 % éch. 21/01/2050	3 900	3 040	0,09
Empresa de los Ferrocarriles del Estado			
3,068 % éch. 18/08/2050	1 500	918	0,03
3,830 % éch. 14/09/2061	7 000	4 777	0,14
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.			
3,650 % éch. 07/05/2030	1 600	1 468	0,04
Empresa Nacional del Petroleo			
3,450 % éch. 16/09/2031	8 700	7 291	0,21
4,500 % éch. 14/09/2047	3 000	2 260	0,07
6,150 % éch. 10/05/2033	6 300	6 297	0,19
GNL Quintero S.A.			
4,634 % éch. 31/07/2029	7 113	6 922	0,20
		60 045	1,77
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement chilien			
3,250 % éch. 21/09/2071	11 900	7 750	0,23
3,625 % éch. 30/10/2042 (i)	2 000	1 623	0,05
4,340 % éch. 07/03/2042 (i)	13 000	11 573	0,34
4,950 % éch. 05/01/2036 (a)	3 000	2 965	0,09
5,330 % éch. 05/01/2054 (a)	1 600	1 592	0,04
		25 503	0,75
Total Chili		85 548	2,52
CHINE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Yango Justice International Ltd.			
7,500 % éch. 15/04/2024 ^	4 700	99	0,00
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.			
3,125 % éch. 16/07/2025	9 500	8 407	0,25
Total Chine		8 506	0,25
COLOMBIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Davivienda S.A.			
6,650 % éch. 22/04/2031 (e)(g)	900	663	0,02
Ecopetrol S.A.			
4,625 % éch. 02/11/2031	9 800	7 574	0,22
5,375 % éch. 26/06/2026	2 200	2 107	0,06
5,875 % éch. 28/05/2045	3 100	2 127	0,06
6,875 % éch. 29/04/2030	200	183	0,01
7,375 % éch. 18/09/2043	2 400	2 004	0,06
		14 658	0,43
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement colombien			
3,125 % éch. 15/04/2031	15 507	11 731	0,35
3,875 % éch. 15/02/2061 (i)	13 000	7 310	0,21
4,125 % éch. 15/05/2051	13 700	8 233	0,24
4,500 % éch. 28/01/2026	5 600	5 345	0,16
4,500 % éch. 15/03/2029	400	351	0,01
5,000 % éch. 15/06/2045	3 400	2 375	0,07
5,200 % éch. 15/05/2049	12 700	8 757	0,26
5,625 % éch. 26/02/2044	4 800	3 586	0,11
7,375 % éch. 18/09/2037	1 400	1 334	0,04
7,500 % éch. 02/02/2034	10 200	10 000	0,29
		59 022	1,74
Total Colombie		73 680	2,17
COSTA RICA			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement costaricain			
5,625 % éch. 30/04/2043	3 000	2 585	0,08

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Billets de la Banque centrale de République dominicaine				
12,000 % éch. 03/10/2025	DOP	48 600	\$924	0,03
13,000 % éch. 05/12/2025		787 600	15 365	0,45
13,000 % éch. 30/01/2026		292 600	5 724	0,17
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine				
4,875 % éch. 23/09/2032	\$	6 200	5 293	0,16
5,300 % éch. 21/01/2041		7 700	6 052	0,18
5,500 % éch. 27/01/2025		9 600	9 461	0,28
5,500 % éch. 22/02/2029		17 500	16 418	0,48
5,875 % éch. 30/01/2060		7 650	5 947	0,18
5,950 % éch. 25/01/2027		15 000	14 739	0,43
6,000 % éch. 19/07/2028		12 400	12 116	0,36
6,000 % éch. 22/02/2033		10 800	9 987	0,29
6,400 % éch. 05/06/2049		250	214	0,01
6,875 % éch. 29/01/2026		6 400	6 462	0,19
7,450 % éch. 30/04/2044		100	98	0,00
13,625 % éch. 03/02/2033	DOP	631 800	14 206	0,42
13,625 % éch. 10/02/2034		489 000	11 168	0,33
Total République dominicaine			134 174	3,96

ÉQUATEUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Ecuador Social Bond SARL				
0,000 % éch. 30/01/2035 (d)	\$	856	651	0,02
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur				
0,000 % éch. 31/07/2030 (d)		5 332	1 551	0,04
1,500 % éch. 31/07/2040		22 463	7 043	0,21
2,500 % éch. 31/07/2035		22 231	7 779	0,23
5,500 % éch. 31/07/2030		16 626	8 083	0,24
			24 456	0,72
Total Équateur			25 107	0,74

ÉGYPTE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement égyptien				
5,250 % éch. 06/10/2025		6 000	4 583	0,13
5,625 % éch. 16/04/2030	€	5 370	3 262	0,10
5,875 % éch. 16/02/2031	\$	5 900	3 284	0,10
6,375 % éch. 11/04/2031	€	9 100	5 542	0,16
6,875 % éch. 30/04/2040 (i)	\$	3 100	1 691	0,05
7,053 % éch. 15/01/2032		7 300	4 158	0,12
7,300 % éch. 30/09/2033		15 700	8 687	0,26
7,500 % éch. 16/02/2061		2 600	1 311	0,04
7,625 % éch. 29/05/2032		11 100	6 477	0,19
7,903 % éch. 21/02/2048		19 700	10 171	0,30
8,150 % éch. 20/11/2059		2 100	1 093	0,03
8,500 % éch. 31/01/2047		9 000	4 805	0,14
8,875 % éch. 29/05/2050		12 300	6 662	0,20
Total Égypte			61 706	1,82

SALVADOR				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement salvadorien				
6,375 % éch. 18/01/2027		1 100	773	0,02
7,125 % éch. 20/01/2050		12 707	7 102	0,21
7,625 % éch. 21/09/2034		3 800	2 225	0,07
7,625 % éch. 01/02/2041		530	304	0,01
7,650 % éch. 15/06/2035		200	119	0,00
8,250 % éch. 10/04/2032		2 610	1 691	0,05
8,625 % éch. 28/02/2029		185	124	0,00
9,500 % éch. 15/07/2052		1 400	888	0,03
Total Salvador			13 226	0,39

ÉTHIOPIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement éthiopien				
6,625 % éch. 11/12/2024		3 300	2 289	0,07

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	
GABON				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement gabonais				
6,625 % éch. 06/02/2031	\$	400	\$319	0,01
7,000 % éch. 24/11/2031		400	319	0,01
Total Gabon			638	0,02

GÉORGIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Georgian Railway JSC				
4,000 % éch. 17/06/2028		300	260	0,01

GHANA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Ghana				
6,375 % éch. 11/02/2027 ^		11 100	4 817	0,14
7,625 % éch. 16/05/2029 ^		800	345	0,01
7,750 % éch. 07/04/2029 ^		7 600	3 272	0,09
7,875 % éch. 11/02/2035 ^		4 029	1 763	0,05
8,125 % éch. 26/03/2032 ^		6 100	2 636	0,08
8,625 % éch. 07/04/2034 ^		8 500	3 662	0,11
8,750 % éch. 11/03/2061 ^		1 750	729	0,02
8,875 % éch. 07/05/2042 ^		1 600	662	0,02
8,950 % éch. 26/03/2051 ^		4 600	1 929	0,06
Total Ghana			19 815	0,58

GUATEMALA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Guatemala				
4,375 % éch. 05/06/2027		8 600	8 152	0,24
4,600 % éch. 03/05/2026		6 900	6 605	0,19
4,650 % éch. 07/10/2041		800	642	0,02
4,875 % éch. 13/02/2028		7 120	6 790	0,20
5,375 % éch. 24/04/2032		300	286	0,01
6,600 % éch. 13/06/2036		7 400	7 455	0,22
Total Guatemala			29 930	0,88

HONG KONG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AIA Group Ltd.				
3,200 % éch. 16/09/2040		900	691	0,02
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % éch. 02/10/2026	€	3 000	2 258	0,07
5,000 % éch. 18/05/2026	\$	200	150	0,00
5,050 % éch. 27/01/2027		1 300	900	0,03
6,850 % éch. 02/07/2024		2 200	1 986	0,06
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,875 % éch. 13/11/2029		300	232	0,01
4,500 % éch. 29/05/2029		3 650	2 929	0,08
5,000 % éch. 19/11/2025		3 700	3 417	0,10
5,500 % éch. 16/01/2025		200	190	0,01
			12 753	0,38

ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Airport Authority Hong Kong				
2,100 % éch. 08/03/2026 (e)		7 500	6 864	0,20
2,625 % éch. 04/02/2051		1 000	695	0,02
4,875 % éch. 12/01/2030		9 400	9 559	0,28
Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong				
3,750 % éch. 07/06/2032	€	7 700	8 461	0,25
			25 579	0,75
Total Hong Kong			38 332	1,13

HONGRIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
MVM Energetika Zrt				
7,500 % éch. 09/06/2028	\$	5 600	5 591	0,16

ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Banque de développement hongroise				
6,500 % éch. 29/06/2028		15 300	15 174	0,45
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
0,500 % éch. 18/11/2030	€	800	637	0,02
1,625 % éch. 28/04/2032		1 418	1 178	0,03
2,125 % éch. 22/09/2031	\$	2 700	2 093	0,06

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	
3,125 % éch. 21/09/2051	\$	2 500	\$1 560	0,05
5,250 % éch. 16/06/2029		16 800	16 382	0,48
5,500 % éch. 16/06/2034		700	681	0,02
6,250 % éch. 22/09/2032		8 000	8 216	0,24
6,750 % éch. 25/09/2052		3 500	3 620	0,11
7,625 % éch. 29/03/2041		5 000	5 650	0,17
Magyar Export-Import Bank				
6,125 % éch. 04/12/2027		10 600	10 498	0,31
			65 689	1,94
Total Hongrie			71 280	2,10

INDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
NTPC Ltd.				
3,750 % éch. 03/04/2024		2 000	1 967	0,06
Reliance Industries Ltd.				
2,875 % éch. 12/01/2032		2 400	2 003	0,06
			3 970	0,12

ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Export-Import Bank of India				
3,375 % éch. 05/08/2026		600	565	0,01
3,875 % éch. 12/03/2024		4 100	4 035	0,12
			4 600	0,13
Total Inde			8 570	0,25

INDONÉSIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Indonesia Asahan Aluminium PT				
5,450 % éch. 15/05/2030		8 000	7 764	0,23
5,800 % éch. 15/05/2050		3 000	2 650	0,08
LLPL Capital Pte. Ltd.				
6,875 % éch. 04/02/2039		910	818	0,02
Pelabuhan Indonesia Persero PT				
4,250 % éch. 05/05/2025		6 500	6 344	0,19
4,875 % éch. 01/10/2024		3 100	3 072	0,09
5,375 % éch. 05/05/2045		3 693	3 486	0,10

Pertamina Persero PT				
1,400 % éch. 09/02/2026		600	543	0,01
4,175 % éch. 21/01/2050		5 000	3 951	0,12
5,625 % éch. 20/05/2043		1 800	1 737	0,05
6,000 % éch. 03/05/2042		21 100	21 238	0,63
6,450 % éch. 30/05/2044		12 400	12 894	0,38
6,500 % éch. 07/11/2048		9 500	9 892	0,29
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
4,000 % éch. 30/06/2050		16 800	12 024	0,35
4,125 % éch. 15/05/2027		6 300	6 006	0,18
4,375 % éch. 05/02/2050		2 900	2 185	0,06
5,250 % éch. 24/10/2042		2 300	2 055	0,06
5,250 % éch. 15/05/2047		8 400	7 382	0,22
6,150 % éch. 21/05/2048		2 700	2 613	0,08
6,250 % éch. 25/01/2049		7 800	7 689	0,23
			114 343	3,37

ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement indonésien				
1,100 % éch. 12/03/2033	€	8 400	6 823	0,20
4,750 % éch. 18/07/2047	\$	2 700	2 552	0,08
5,350 % éch. 11/02/2049		200	203	0,01
5,650 % éch. 11/01/2053		800	839	0,02
6,625 % éch. 17/02/2037		5 900	6 747	0,20
6,750 % éch. 15/01/2044		4 000	4 692	0,14
7,750 % éch. 17/01/2038		1 000	1 252	0,04
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				
3,800 % éch. 23/06/2050		7 000	5 541	0,16
			28 649	0,85
Total Indonésie			142 992	4,22

INTERNATIONALES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS				
Project Mercury				
TBD % éch. 17/07/2030	€	6 700	7 310	0,21
State Oil Company of the Azerbaijan Republic				
TBD % éch. 26/11/2024	\$	1 000	975	0,03
Total Internationales			8 285	0,24

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
IRLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC 5,950 % éch. 15/04/2030	\$ 6 600	396	0,01
Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC 6,927 % éch. 19/02/2027	22 646	21 287	0,63
Russian Railways Via RZD Capital PLC 7,487 % éch. 25/03/2031 ^	£ 500	494	0,01
Saderea DAC 12,500 % éch. 30/11/2026 ^	\$ 6 199	2 635	0,08
Total Irlande		24 812	0,73

ISRAËL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Bank Hapoalim B.M. 3,255 % éch. 21/01/2032 (g)	9 900	8 511	0,25
Israel Electric Corp. Ltd. 4,250 % éch. 14/08/2028	5 400	5 041	0,15
5,000 % éch. 12/11/2024	200	198	0,01
Leviathan Bond Ltd. 6,125 % éch. 30/06/2025	2 100	2 058	0,06
6,500 % éch. 30/06/2027	6 800	6 528	0,19
		22 336	0,66

ÉMISIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement israélien			
0,150 % éch. 31/07/2023	ILS 23 700	6 363	0,19
1,500 % éch. 30/11/2023	149 700	39 832	1,17
		46 195	1,36
Total Israël		68 531	2,02

CÔTE D'IVOIRE			
CREDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
République de Côte d'Ivoire 7,950 % éch. 19/03/2027	€ 3 440	3 659	0,11

ÉMISIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire			
4,875 % éch. 30/01/2032	6 700	5 710	0,17
5,250 % éch. 22/03/2030	500	462	0,01
5,875 % éch. 17/10/2031	2 400	2 198	0,06
6,625 % éch. 22/03/2048	300	233	0,01
		8 603	0,25
Total Côte d'Ivoire		12 262	0,36

JAMAÏQUE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
TransJamaican Highway Ltd. 5,750 % éch. 10/10/2036	\$ 3 273	2 706	0,08

JAPON			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,063 % éch. 12/09/2025	16 500	16 308	0,48

JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Corsair International Ltd. 7,772 % éch. 28/01/2027	€ 15 900	17 260	0,51
8,122 % éch. 28/01/2029	6 900	7 472	0,22
Total Jersey, Îles Anglo-normandes		24 732	0,73

JORDANIE			
ÉMISIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement jordanien			
4,950 % éch. 07/07/2025	\$ 2 200	2 134	0,06
5,750 % éch. 31/01/2027	13 200	12 705	0,38
5,850 % éch. 07/07/2030	2 100	1 930	0,06
6,125 % éch. 29/01/2026	6 250	6 144	0,18
7,375 % éch. 10/10/2047	700	605	0,02
7,500 % éch. 13/01/2029	6 100	6 149	0,18
Total Jordanie		29 667	0,88

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
KAZAKHSTAN			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
KazMunayGas National Co. JSC 3,500 % éch. 14/04/2033	\$ 1 300	\$ 1 010	0,03
4,750 % éch. 19/04/2027	16 600	15 781	0,47
5,375 % éch. 24/04/2030	1 200	1 116	0,03
5,750 % éch. 19/04/2047	15 400	12 639	0,37
6,375 % éch. 24/10/2048	4 300	3 686	0,11
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd. 3,250 % éch. 15/08/2030	5 400	4 136	0,12
Total Kazakhstan		38 368	1,13

KENYA			
ÉMISIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement kenyan			
6,875 % éch. 24/06/2024	3 750	3 576	0,11
8,000 % éch. 22/05/2032	1 300	1 102	0,03
Total Kenya		4 678	0,14

LIBAN			
ÉMISIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement libanais			
8,250 % éch. 17/05/2034 ^	9 700	653	0,02

LUXEMBOURG			
ACTIONS ORDINAIRES			
DrillCo Holding Lux S.A. (c)	143 033	2 746	0,08
DrillCo Holding Lux S.A. (c)(h)	364 034	6 989	0,21
Total des Actions ordinaires		\$ 9 735	0,29

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
-------------	-------------------------------------	----------------------------------	---------------------------

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Constellation Oil Services Holding S.A. 13,500 % éch. 30/06/2025			
	\$ 1 704	1 682	0,05
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)			
3,000 % éch. 31/12/2026 (b)	3 855	2 281	0,07
FORESEA Holding S.A. 7,500 % éch. 15/06/2030	6 316	5 578	0,16
Greensaif Pipelines Bidco SARL			
6,129 % éch. 23/02/2038	4 700	4 808	0,14
6,510 % éch. 23/02/2042	4 600	4 787	0,14
Guara Norte SARL 5,198 % éch. 15/06/2034	12 380	10 854	0,32
Petrorio Luxembourg Trading SARL 6,125 % éch. 09/06/2026	7 100	6 827	0,20
TMS Issuer SARL 5,780 % éch. 23/08/2032	6 600	6 809	0,20
Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % éch. 01/10/2026	3 900	1 282	0,04
		44 908	1,32
Total Luxembourg		54 643	1,61

MACÉDOINE DU NORD			
ÉMISIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du nord			
6,960 % éch. 13/03/2027	€ 7 600	8 475	0,25

MALAISIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Axiata SPV2 Bhd. 2,163 % éch. 19/08/2030	\$ 1 900	1 616	0,05
Khazanah Capital Ltd. 4,876 % éch. 01/06/2033	6 100	6 043	0,18
Khazanah Global Sukuk Bhd. 4,687 % éch. 01/06/2028	8 200	8 094	0,24
Petronas Capital Ltd. 4,500 % éch. 18/03/2045	500	460	0,01
4,550 % éch. 21/04/2050	9 700	8 919	0,26
		25 132	0,74

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement malaisien			
3,800 % éch. 17/08/2023	MYR 107 200	\$ 22 986	0,68
Total Malaisie		48 118	1,42

ÎLE MAURICE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % éch. 29/07/2026	\$ 200	188	0,01

MEXIQUE			
ACTIONS ORDINAIRES			
Hipotecaria Su Casita S.A. (c)	39 443	0	0,00
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (c)	2 622	1	0,00
Total des Actions ordinaires		1	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
-------------	-------------------------------------	----------------------------------	---------------------------

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Mercantil del Norte S.A. 6,625 % éch.			
24/01/2032 (e)(g)	\$ 4 100	3 173	0,09
6,750 % éch.			
27/09/2024 (e)(g)	3 000	2 885	0,09
7,500 % éch.			
27/06/2029 (e)(g)	5 400	4 694	0,14
Comision Federal de Electricidad 6,264 % éch. 15/02/2052	5 700	4 807	0,14
Corp. GEO S.A.B. de C.V. 8,875 % éch. 25/09/2014 ^	13 920	0	0,00
9,250 % éch. 30/06/2020 ^	1 000	0	0,00
Industrias Penoles S.A.B. de C.V. 4,750 % éch. 06/08/2050	3 900	3 109	0,09
Petroleos Mexicanos 3,625 % éch. 24/11/2025	€ 1 400	1 398	0,04
4,875 % éch. 21/02/2028	1 300	1 178	0,04
5,812 % éch. 24/08/2023	6 500	7 069	0,21
6,350 % éch. 12/02/2048	\$ 30 367	18 396	0,54
6,500 % éch. 02/06/2041	2 000	1 272	0,04
6,625 % éch. 15/06/2035	9 350	6 528	0,19
6,625 % éch. 15/06/2038	200	134	0,00
6,700 % éch. 16/02/2032	12 558	9 560	0,28
6,750 % éch. 21/09/2047	17 180	10 804	0,32
6,840 % éch. 23/01/2030	278	221	0,01
6,950 % éch. 28/01/2060	29 647	18 515	0,55
7,690 % éch. 23/01/2050	66 636	45 222	1,33
10,000 % éch. 07/02/2033	1 000	917	0,03
10,000 % éch. 07/02/2033 (i)	8 950	8 206	0,24
Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V. 5,375 % éch. 04/04/2032 (i)	7 250	6 573	0,19
		154 661	4,56

ÉMISIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement mexicain			
3,750 % éch. 19/04/2071	9 200	6 160	0,18
3,771 % éch. 24/05/2061	15 400	10 509	0,31
5,000 % éch. 27/04/2051 (i)	14 100	12 261	0,36
5,400 % éch. 09/02/2028	9 500	9 683	0,29
5,750 % éch. 12/10/2110	43 450	38 884	1,15
6,338 % éch. 04/05/2053	8 685	8 869	0,26
6,350 % éch. 09/02/2035	16 400	17 282	0,51
		103 648	3,06
Total Mexique		258 310	7,62

MAROC			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
OCP S.A. 3,750 % éch. 23/06/2031	10 850	9 001	0,27
5,125 % éch. 23/06/2051	4 300	3 144	0,09
Total Maroc		12 145	0,36

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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				EMISSIONS SOUVERAINES				QATAR			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Obligation internationale du gouvernement panaméen				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ATP Tower Holdings LLC				3,870 % éch. 23/07/2060	\$ 1 400	\$ 931	0,03	QatarEnergy			
4,050 % éch. 27/04/2026	\$ 10 600	\$ 9 126	0,27	4,300 % éch. 29/04/2053	9 900	7 392	0,22	2,250 % éch. 12/07/2031	\$ 9 100	\$ 7 644	0,23
NAMIBIE				EMISSIONS SOUVERAINES				EMISSIONS SOUVERAINES			
EMISSIONS SOUVERAINES				Obligation internationale du gouvernement namibien				Obligation internationale du gouvernement qatari			
5,250 % éch. 29/10/2025	6 000	5 712	0,17	4,500 % éch. 15/05/2047	6 100	4 867	0,14	3,125 % éch. 12/07/2041	27 350	20 985	0,62
PAYS-BAS				EMISSIONS SOUVERAINES				Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Obligation internationale du gouvernement paraguayen				5,838 % éch. 30/09/2027			
Metinvest BV				4,500 % éch. 01/04/2056	3 400	2 562	0,07	6,332 % éch. 30/09/2027	1 133	1 148	0,03
8,500 % éch. 23/04/2026	5 700	3 933	0,12	4,500 % éch. 19/01/2063	8 200	6 020	0,18		294	300	0,01
Prosus NV				6,400 % éch. 14/02/2035	13 900	14 530	0,43	61 213 1,81			
1,539 % éch. 03/08/2028	€ 2 400	2 159	0,06	6,700 % éch. 26/01/2036	1 300	1 395	0,04	EMISSIONS SOUVERAINES			
2,031 % éch. 03/08/2032	1 200	933	0,03	6,853 % éch. 28/03/2054	3 900	4 067	0,12	Obligation internationale du gouvernement panaméen			
3,257 % éch. 19/01/2027	\$ 3 900	3 527	0,10	8,125 % éch. 28/04/2034	300	355	0,01	4,400 % éch. 16/04/2050	5 800	5 289	0,16
3,832 % éch. 08/02/2051	2 100	1 291	0,04	8,875 % éch. 30/09/2027	1 700	1 955	0,06	4,625 % éch. 02/06/2046	300	286	0,01
4,027 % éch. 03/08/2050	1 600	1 006	0,03	Total Panama			66 856 1,97	4,817 % éch. 14/03/2049	1 800	1 733	0,05
Republic of Angola Via Avenir BV				PARAGUAY				5,103 % éch. 23/04/2048			
10,163 % éch. 03/07/2023	2 533	2 520	0,07	EMISSIONS SOUVERAINES				Obligation internationale du gouvernement roumain			
12,772 % éch. 03/07/2023	4 916	4 916	0,15	Obligation internationale du gouvernement paraguayen				1,750 % éch. 13/07/2030			
Total Pays-Bas				2,739 % éch. 29/01/2033				€ 12 000 10 009 0,30			
		20 285 0,60		3,849 % éch. 28/06/2033	2 600	2 263	0,07	2,000 % éch. 08/12/2026	3 900	3 892	0,11
NIGERIA				4,700 % éch. 27/03/2027				2,124 % éch. 16/07/2031 (i)			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,400 % éch. 30/03/2050				1 000 830 0,02			
BOI Finance BV				5,850 % éch. 21/08/2033 (a)				4 700 4 461 0,13			
7,500 % éch. 16/02/2027	€ 14 400	13 569	0,40	6,100 % éch. 11/08/2044	2 400	2 278	0,07	2,375 % éch. 19/04/2027	1 750	1 745	0,05
EMISSIONS SOUVERAINES				Total Paraguay				2,625 % éch. 02/12/2040			
Obligation internationale du gouvernement nigérian				15 194 0,45				2,875 % éch. 13/04/2042			
6,125 % éch. 28/09/2028	\$ 6 800	5 680	0,17	PÉROU				3,500 % éch. 03/04/2034			
6,375 % éch. 12/07/2023	8 650	8 633	0,25	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,750 % éch. 07/02/2034			
6,500 % éch. 28/11/2027	5 844	5 107	0,15	Banco de Credito del Peru S.A.				3,875 % éch. 29/10/2035			
7,143 % éch. 23/02/2030	7 000	5 886	0,17	4,650 % éch. 17/09/2024	PEN 26 100	6 904	0,20	4,000 % éch. 14/02/2051	\$ 2 700	1 934	0,06
7,375 % éch. 28/09/2033	7 400	5 845	0,17	InRetail Consumer				€ 1 000 852 0,02			
7,625 % éch. 28/11/2047	9 846	7 028	0,21	3,250 % éch. 22/03/2028	\$ 6 300	5 416	0,16	4,125 % éch. 11/03/2039	5 600	4 725	0,14
7,696 % éch. 23/02/2038	4 800	3 609	0,11	Peru LNG SRL				5,000 % éch. 03/04/2049			
7,875 % éch. 16/02/2032	5 000	4 206	0,12	5,375 % éch. 22/03/2030	6 974	5 620	0,17	6,125 % éch. 22/01/2044	\$ 4 050	3 915	0,12
8,250 % éch. 28/09/2051	4 400	3 297	0,10	Petroleos del Peru S.A.				7,625 % éch. 17/01/2053			
8,375 % éch. 24/03/2029	2 600	2 347	0,07	4,750 % éch. 19/06/2032	2 600	1 990	0,06	Total Roumanie			
Total Nigeria				5,625 % éch. 19/06/2047	17 869	11 542	0,34	73 017 2,15			
		51 638 1,52		EMISSIONS SOUVERAINES				RUSSIE			
OMAN				Obligation internationale du gouvernement péruvien				EMISSIONS SOUVERAINES			
EMISSIONS SOUVERAINES				3,230 % éch. 28/07/2121				Obligation internationale du gouvernement russe			
Obligation internationale du gouvernement omanais				3,600 % éch. 15/01/2072				1,125 % éch. 20/11/2027 ^			
4,875 % éch. 01/02/2025	1 100	1 084	0,03	6,550 % éch. 14/03/2037	14 243	16 013	0,47	€ 500 256 0,01			
5,625 % éch. 17/01/2028	6 690	6 630	0,19	8,750 % éch. 21/11/2033	785	998	0,03	1,850 % éch. 20/11/2032 ^	8 900	4 564	0,14
6,000 % éch. 01/08/2029	16 100	16 137	0,48	Total Pérou				4,250 % éch. 26/06/2027 ^			
6,250 % éch. 25/01/2031	7 700	7 827	0,23	19 945 0,59				5,000 % éch. 21/03/2029 ^			
6,500 % éch. 08/03/2047	3 473	3 247	0,10	PHILIPPINES				4,375 % éch. 27/05/2026 ^			
6,750 % éch. 28/10/2027	13 300	13 764	0,41	EMISSIONS SOUVERAINES				5,100 % éch. 28/03/2035 ^			
6,750 % éch. 17/01/2048	3 900	3 757	0,11	Obligation internationale du gouvernement philippin				5,250 % éch. 23/06/2047 ^			
7,000 % éch. 25/01/2051	2 400	2 382	0,07	2,650 % éch. 10/12/2045	7 400	4 996	0,15	5,250 % éch. 23/06/2047 ^	200	89	0,00
Total Oman				2,950 % éch. 05/05/2045	1 600	1 142	0,03	7,500 % éch. 31/03/2030 ^	174	115	0,00
		54 828 1,62		3,700 % éch. 01/03/2041	650	536	0,02	Total Russie			
PAKISTAN				5,000 % éch. 17/07/2033	7 200	7 300	0,22	9 396 0,28			
EMISSIONS SOUVERAINES				6,375 % éch. 23/10/2034	847	947	0,03	ARABIE SAOUDITE			
Obligation internationale du gouvernement pakistanais				9,500 % éch. 02/02/2030	4 179	5 246	0,15	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
6,000 % éch. 08/04/2026	3 952	1 936	0,06	Total Philippines				Saudi Arabian Oil Co.			
6,875 % éch. 05/12/2027	3 500	1 680	0,05	20 167 0,60				2,250 % éch. 24/11/2030			
7,375 % éch. 08/04/2031	3 870	1 790	0,05	POLOGNE				2,875 % éch. 16/04/2024			
8,250 % éch. 15/04/2024	2 500	1 812	0,05	EMISSIONS SOUVERAINES				3,500 % éch. 16/04/2029			
8,875 % éch. 08/04/2051	10 500	4 694	0,14	Bank Gospodarstwa Krajowego				3,500 % éch. 24/11/2070			
Total Pakistan				5,375 % éch. 22/05/2033	5 600	5 578	0,16	45 000 29 997 0,89			
		11 912 0,35		Obligation internationale du gouvernement polonais				37 102 1,10			
PANAMA				4,875 % éch. 04/10/2033	8 500	8 359	0,25	EMISSIONS SOUVERAINES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,500 % éch. 16/11/2027	10 250	10 531	0,31	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite			
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.				5,500 % éch. 04/04/2053	9 500	9 585	0,28	2,250 % éch. 02/02/2033			
5,125 % éch. 11/08/2061	7 100	5 481	0,16	Total Pologne				2 000 1 614 0,05			
Banco General S.A.				34 053 1,00				3,250 % éch. 22/10/2030			
5,250 % éch. 07/05/2031 (e)(g)	400	346	0,01	Bank Gospodarstwa Krajowego				3,450 % éch. 02/02/2061			
5,250 % éch. 07/05/2031 (e)	8 300	7 176	0,21	Obligation internationale du gouvernement polonais				3,750 % éch. 21/01/2055			
Banco Nacional de Panama				5,000 % éch. 17/07/2033				4,500 % éch. 26/10/2046 (i)			
2,500 % éch. 11/08/2030	5 900	4 648	0,14	6,375 % éch. 23/10/2034	847	947	0,03	4,625 % éch. 04/10/2047	300	268	0,01
Total Panama				9,500 % éch. 02/02/2030	4 179	5 246	0,15	4,750 % éch. 18/01/2028	35 900	35 637	1,05
		17 651 0,52		Total Pologne				4,875 % éch. 18/07/2033			
				34 053 1,00				37 400 37 408 1,10			
				34 053 1,00				Total Arabie saoudite			
				34 053 1,00				150 715 4,45			

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF (en milliers)	JUSTE EN % DE L'ACTIF NET
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Antofagasta PLC 2,375 % éch. 14/10/2030	\$ 2 200	\$ 1 795	0,05
Barclays PLC 5,304 % éch. 09/08/2026	8 400	8 197	0,24
HSBC Holdings PLC 3,973 % éch. 22/05/2030	400	360	0,01
Lloyds Banking Group PLC 4,716 % éch. 11/08/2026	3 700	3 597	0,11
NatWest Group PLC 2,875 % éch. 19/09/2026 4,269 % éch. 22/03/2025	£ 400 \$ 200	461 197	0,01 0,01
4,800 % éch. 05/04/2026 5,076 % éch. 27/01/2030	1 100 200	1 068 191	0,03 0,01
Santander UK Group Holdings PLC 6,833 % éch. 21/11/2026	900	903	0,03
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC 8,250 % éch. 09/07/2026 ^	16 100	6 198	0,18
Ukreximbank Via Biz Finance PLC 9,750 % éch. 22/01/2025	1 458	1 275	0,04
		24 242	0,72

TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Canada Square Funding PLC 5,316 % éch. 17/01/2059	£ 2 749	3 475	0,10
Formentera Issuer PLC 5,357 % éch. 28/07/2047	154	194	0,01
Polaris PLC 6,154 % éch. 27/05/2057	322	409	0,01
Rochester Financing PLC 5,602 % éch. 18/12/2044	2 951	3 707	0,11
Stratton Mortgage Funding PLC 5,765 % éch. 12/03/2052	691	876	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,841 % éch. 20/07/2045 6,097 % éch. 20/05/2045 6,546 % éch. 20/02/2054	705 1 138 2 386	897 1 442 3 034	0,03 0,04 0,09
Tower Bridge Funding PLC 5,629 % éch. 20/12/2063	1 910	2 417	0,07
Warwick Finance Residential Mortgages PLC 0,000 % éch. 21/12/2049 (d) 5,865 % éch. 21/12/2049 6,564 % éch. 21/12/2049 7,064 % éch. 21/12/2049 7,564 % éch. 21/12/2049 8,064 % éch. 21/12/2049	0 3 311 735 367 210 210	596 4 190 926 460 262 258	0,02 0,12 0,03 0,01 0,01 0,01
		23 143	0,68

ÉTATS-UNIS			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS			
Aames Mortgage Investment Trust 5,630 % éch. 25/04/2036	\$ 2 964	2 636	0,08
Argent Securities Trust 5,450 % éch. 25/07/2036	942	803	0,02
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,630 % éch. 25/05/2035	446	402	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,630 % éch. 25/02/2037 6,275 % éch. 25/11/2035	1 539 3 657	1 481 3 556	0,04 0,10
GSAA Home Equity Trust 5,590 % éch. 25/05/2047 5,630 % éch. 25/11/2036 6,502 % éch. 25/11/2036	723 259 868	456 92 346	0,01 0,00 0,01
Home Equity Asset Trust 6,500 % éch. 25/02/2033	218	203	0,01
Humboldt Americas LLC 0,000 % éch. 31/07/2022	COP 20 000 000	4 722	0,14
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,420 % éch. 25/08/2036	\$ 100	89	0,00
Lehman XS Trust 5,058 % éch. 25/01/2036 ^	2 078	1 930	0,06

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF (en milliers)	JUSTE EN % DE L'ACTIF NET
ACTIONS			
Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (c)(h)	4 243 669	460	0,01
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
DAE Funding LLC 2,625 % éch. 20/03/2025	\$ 3 500	3 295	0,10
Pricoa Global Funding 4,200 % éch. 28/08/2025	450	437	0,01
Rio Oil Finance Trust 8,200 % éch. 06/04/2028 9,250 % éch. 06/07/2024 9,750 % éch. 06/01/2027	8 794 4 464 6 439	8 849 4 507 6 648	0,26 0,13 0,20
Rutas 2 and 7 Finance Ltd. 0,000 % éch. 30/09/2036 (d)	5 040	3 305	0,10
		27 041	0,80

TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. 4,407 % éch. 15/11/2061	3 700	3 517	0,10
Banc of America Mortgage Trust 3,896 % éch. 25/02/2036 ^	4	4	0,00
BCAP LLC Trust 3,676 % éch. 26/05/2037	3 503	3 158	0,09
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,887 % éch. 25/05/2047 ^ 4,033 % éch. 25/01/2035	84 4	75 4	0,00 0,00
Bear Stearns ALT-A Trust 4,195 % éch. 25/05/2035	61	57	0,00
Benchmark Mortgage Trust 3,666 % éch. 15/01/2051 4,261 % éch. 10/10/2051	1 700 4 800	1 556 4 435	0,05 0,13
Citigroup Mortgage Loan Trust 3,974 % éch. 25/09/2037 ^	169	149	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust 5,800 % éch. 25/10/2036	1 016	848	0,03
Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % éch. 25/05/2036 ^ 5,797 % éch. 20/12/2035	1 025 591	420 552	0,01 0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,573 % éch. 20/05/2036 ^ 3,884 % éch. 25/11/2037	85 434	78 397	0,00 0,01
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 5,590 % éch. 25/11/2034	197	186	0,01

TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. 4,407 % éch. 15/11/2061	3 700	3 517	0,10
Banc of America Mortgage Trust 3,896 % éch. 25/02/2036 ^	4	4	0,00
BCAP LLC Trust 3,676 % éch. 26/05/2037	3 503	3 158	0,09
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,887 % éch. 25/05/2047 ^ 4,033 % éch. 25/01/2035	84 4	75 4	0,00 0,00
Bear Stearns ALT-A Trust 4,195 % éch. 25/05/2035	61	57	0,00
Benchmark Mortgage Trust 3,666 % éch. 15/01/2051 4,261 % éch. 10/10/2051	1 700 4 800	1 556 4 435	0,05 0,13
Citigroup Mortgage Loan Trust 3,974 % éch. 25/09/2037 ^	169	149	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust 5,800 % éch. 25/10/2036	1 016	848	0,03
Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % éch. 25/05/2036 ^ 5,797 % éch. 20/12/2035	1 025 591	420 552	0,01 0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,573 % éch. 20/05/2036 ^ 3,884 % éch. 25/11/2037	85 434	78 397	0,00 0,01
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 5,590 % éch. 25/11/2034	197	186	0,01

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF (en milliers)	JUSTE EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust 5,480 % éch. 25/08/2037 ^	\$ 700	59	0,02
GSMP Mortgage Loan Trust 5,500 % éch. 25/01/2036	144	118	0,00
GSR Mortgage Loan Trust 3,935 % éch. 25/01/2036 ^	25	24	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust 5,976 % éch. 19/10/2035	99	55	0,00
HomeBanc Mortgage Trust 5,670 % éch. 25/01/2036	224	213	0,01
Impac CMB Trust 5,790 % éch. 25/03/2035	76	70	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust 3,062 % éch. 25/11/2037 5,510 % éch. 25/02/2037 5,510 % éch. 25/02/2037 ^ 5,790 % éch. 25/07/2045	204 1 000 314 336	167 964 280 265	0,01 0,03 0,01 0,01
JPMorgan Resecuritization Trust 2,500 % éch. 25/03/2056	224	211	0,01
Lehman XS Trust 5,530 % éch. 25/09/2046	1 974	1 689	0,05
Residential Accreted Loans, Inc. Trust 6,000 % éch. 25/08/2036 ^	346	282	0,01
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 4,491 % éch. 25/09/2037	21	19	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,300 % éch. 25/02/2037	722	651	0,02
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 3,732 % éch. 25/10/2037 ^	551	486	0,01
TBW Mortgage-Backed Trust 6,540 % éch. 25/01/2037 ^	1 270	309	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,772 % éch. 25/02/2037 ^ 3,883 % éch. 25/03/2036 5,046 % éch. 25/01/2046 5,520 % éch. 25/05/2034	158 912 85 142	142 831 74 126	0,00 0,03 0,00 0,00
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 4,478 % éch. 25/10/2036	323	301	0,01
		23 306	0,69

AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Fannie Mae 4,323 % éch. 01/03/2036	14	14	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/02/2038	1	1	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 2,500 % éch. 01/08/2053 3,500 % éch. 01/08/2053	12 450 14 100	10 575 12 863	0,31 0,38
		23 453	0,69

OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain 1,750 % éch. 15/08/2041 2,375 % éch. 15/02/2042 3,250 % éch. 15/05/2042 3,375 % éch. 15/08/2042	12 300 25 000 113 500 17 800	8 650 19 476 101 339 16 165	0,26 0,57 2,99 0,48
Billets du Trésor américain 2,375 % éch. 15/05/2029 2,625 % éch. 31/07/2029 3,125 % éch. 31/08/2029 4,000 % éch. 28/02/2030 (i)	7 900 30 000 52 000 33 100	7 205 27 719 49 400 33 082	0,21 0,82 1,46 0,97
		263 036	7,76

ACTIONS			
BONS DE SOUSCRIPTION			
Constellation Oil Services Holding S.A. « D » - Exp. 10/06/2071 (h)	5	0	0,00
Total États-Unis		377 372	11,13

OUZBÉKISTAN			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement ouzbek 3,700 % éch. 25/11/2030 3,900 % éch. 19/10/2031	\$ 200 8 400	162 6 773	0,00 0,20
Total Ouzbékistan		6 935	0,20

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	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VENEZUELA				ÎLES VIERGES BRITANNIQUES				FONDS D'INVESTISSEMENT			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
Petroleos de Venezuela S.A.				CLP Power Hong Kong Financing Ltd.				PIMCO Funds: Global			
5,375 % éch. 12/04/2027 ^	\$ 73 690	\$ 2 601	0,08	2,125 % éch. 30/06/2030	\$ 5 300	\$ 4 403	0,13	Investors Series plc			
5,500 % éch. 12/04/2037 ^	19 365	751	0,02	ZAMBIE				Fonds PIMCO			
6,000 % éch. 16/05/2024 ^	3 500	136	0,00	ÉMISSIONS SOUVERAINES				Emerging Markets			
				Obligation internationale du gouvernement zambien				Opportunities	2 357 350	\$ 25 082	0,74
		3 488	0,10	5,375 % éch. 20/09/2022 ^	4 050	2 136	0,06	Fund (f)			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				8,500 % éch. 14/04/2024 ^	2 100	1 226	0,04	PIMCO Select Funds plc			
Obligation internationale du gouvernement vénézuélien				Total Zambie		3 362	0,10	- Fonds PIMCO			
7,000 % éch. 31/03/2038 ^	19 650	1 719	0,05	INSTRUMENTS À COURT TERME				US Dollar Short-			
7,650 % éch. 21/04/2025 ^	6 624	579	0,02	BILLETS DE TRÉSORERIE				Term Floating			
7,750 % éch. 13/10/2019 ^	20 130	1 208	0,03	Amcrc PLC				NAV Fund (f)	19 436	194	0,01
8,250 % éch. 13/10/2024 ^	12 483	1 155	0,03	5,450 % éch. 07/07/2023	3 300	3 297	0,10	PIMCO Specialty Funds			
9,000 % éch. 07/05/2023 ^	9 878	889	0,03	Total des Instruments à court terme		3 297	0,10	Ireland p.l.c. -			
9,250 % éch. 15/09/2027 ^	13 410	1 207	0,04	Total des Valeurs mobilières	\$ 3 348 247		98,78	Fonds PIMCO			
9,250 % éch. 07/05/2028 ^	11 868	1 068	0,03					China Bond	384 360	5 009	0,14
11,950 % éch. 05/08/2031 ^	2 930	271	0,01					Fund (f)			
		8 096	0,24					Total des Fonds d'investissement		\$ 30 285	0,89
Total Venezuela		11 584	0,34								
VIETNAM											
ÉMISSIONS SOUVERAINES											
Obligation internationale du gouvernement vietnamien											
4,800 % éch. 19/11/2024	500	492	0,01								

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 septembre	Long	09/2023	464	\$ (767)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	489	642	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	68	(129)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	1 190	(2 206)	(0,06)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	3 031	5 924	0,17
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	4 634	(9 046)	(0,27)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	116	133	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	87	143	0,00
				\$ (5 306)	(0,16)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (5 306)	(0,16)

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
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2024	\$ 500	\$ 3	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	1 500	4	0,00
				\$ 7	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-38 à 5 ans	(1,000) %	20/12/2027	\$ 22 800	\$ (333)	(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	5,585 %	28/06/2026	£ 19 170	\$ (38)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	15/09/2023	\$ 5 700	80	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	21/09/2024	90 600	3 219	0,11
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	11 100	(1 112)	(0,03)

Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-valeur) latente	En % de l'actif net
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500 %	21/06/2027	\$ 13 700	\$ (2 108)	(0,06)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/12/2028	400	(50)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	93 700	(388)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/12/2031	5 700	(975)	(0,03)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,250	21/12/2046	1 200	517	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,500	15/06/2046	600	268	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,415	04/01/2027	BRL 104 000	475	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,453	04/01/2027	57 600	273	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,620	04/01/2027	15 800	90	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,828	02/01/2025	87 000	58	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,220	02/01/2025	210 200	154	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,015	04/01/2027	102 700	(1 342)	(0,04)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,190	02/01/2025	36 500	(196)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,215	02/01/2025	38 600	(210)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,400	02/01/2025	86 600	(524)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	13,400	02/01/2025	124 500	757	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	15/09/2023	\$ 5 700	(81)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/09/2023	400	(4)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	21/09/2023	13 700	(142)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,250	21/09/2023	1 200	10	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,500	15/09/2023	600	5	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,950	30/11/2024	ZAR 560 000	1 093	0,03
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,611	06/06/2028	CZK 866 200	(218)	(0,01)
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	€ 7 400	(64)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,455	10/01/2028	PLN 24 000	(49)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,490	10/01/2028	22 800	(55)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,585	18/05/2028	MXN 48 600	(24)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,740	07/03/2028	242 000	164	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,760	19/05/2028	2 100	(2)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,900	21/05/2027	166 600	(93)	0,00
					\$ (512)	(0,01)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (838)	(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) 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.

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	3,380 %	31/07/2023	5 900	\$ (23)	\$ (28)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	5 900	(23)	(17)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	3 400	(11)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	3 400	(11)	(16)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	2 700	(6)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	2 700	(6)	(10)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	3 300	(11)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	3 300	(11)	(16)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	2 700	(6)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	2 700	(6)	(10)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	5 100	(17)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	5 100	(17)	(21)	0,00
							\$ (148)	\$ (151)	0,00

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

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

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
BOA	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000) %	20/12/2027	\$ 2 300	\$ 76	\$(44)	\$ 32	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	8 500	1 413	(513)	900	0,03
BPS	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000)	20/12/2027	1 100	36	(21)	15	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000)	20/12/2027	2 400	64	(31)	33	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	3 900	651	(238)	413	0,01
GST	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2028	17 000	(449)	(67)	(516)	(0,01)
HUS	Obligation internationale du gouvernement de Dubaï	(1,000)	20/12/2024	3 600	(12)	(26)	(38)	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement de Dubaï	(1,000)	20/12/2024	1 500	(2)	(14)	(16)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	(1,000)	20/06/2026	27 250	1 274	(601)	673	0,02
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2025	6 300	608	(141)	467	0,01
MYC	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	800	135	(50)	85	0,00
					\$ 3 794	\$(1 746)	\$ 2 048	0,06

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 chilien	1,000 %	20/06/2024	\$ 8 100	\$ 26	\$ 45	\$ 71	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	700	4	8	12	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2027	5 000	(18)	93	75	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	13 200	4	102	106	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	2 900	26	25	51	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/12/2031	2 000	(84)	45	(39)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2025	9 600	(526)	363	(163)	0,00
BPS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2027	2 500	(171)	116	(55)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2023	1 100	3	2	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2024	5 400	6	60	66	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	6 800	39	82	121	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2027	10 000	(182)	358	176	0,01
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	5 800	(3)	21	18	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	900	1	3	4	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	3 900	(6)	37	31	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	2 000	(4)	25	21	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2026	4 900	6	49	55	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	32 100	116	446	562	0,02
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	900	3	1	4	0,00
	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	1 800	(8)	13	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement serbe	1,000	20/12/2027	1 800	(159)	78	(81)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	2 900	(5)	9	4	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement argentin	5,000	20/12/2023	6 800	(985)	484	(501)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2024	4 500	12	28	40	0,00
	Obligation internationale du gouvernement hongrois	1,000	20/12/2023	5 300	(38)	53	15	0,00
	Obligation internationale du gouvernement philippin	1,000	20/06/2028	13 500	62	53	115	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/06/2028	3 200	24	12	36	0,00
	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	1 000	(8)	11	3	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/12/2024	15 687	(277)	442	165	0,01
CBK	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2026	5 000	(237)	221	(16)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2024	3 300	8	33	41	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chinois	1,000	20/06/2028	4 500	58	22	80	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	5 800	(2)	20	18	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2024	500	(5)	7	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/06/2028	68 000	251	193	444	0,01
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2026	6 000	11	56	67	0,00
	Obligation internationale du gouvernement panaméen	1,000	20/06/2024	3 400	6	18	24	0,00
	Obligation internationale du gouvernement panaméen	1,000	20/12/2024	5 900	0	54	54	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	2 200	19	20	39	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2024	50 000	429	(51)	378	0,01
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/12/2024	1 200	(41)	54	13	0,00
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30/06/2029	16 000	0	497	497	0,02
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	10 000	(131)	132	1	0,00
GLM	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	800	(3)	5	2	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2026	600	(32)	35	3	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	3 600	33	31	64	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2028	9 900	19	105	124	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	2 700	(40)	49	9	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	1 000	1	3	4	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	20/06/2028	1 200	(20)	19	(1)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	29 100	118	392	510	0,02
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	2 100	7	2	9	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/06/2028	4 200	38	9	47	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2024	3 000	29	(6)	23	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/12/2024	3 413	36	0	36	0,00
HUS	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	100	(1)	2	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2024	9 700	103	(30)	73	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement argentin	5,000	20/12/2023	4 700	(703)	356	(347)	(0,01)
	Banco do Brasil S.A.	1,000	20/12/2024	9 800	(220)	141	(79)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	7 700	41	97	138	0,01
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2027	10 000	(178)	354	176	0,01

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel ⁽¹⁾	Primes payées/(reçues)	Plus-value/(moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
	Obligation internationale du gouvernement nigérian	5,000 %	20/06/2024	\$ 10 000	\$ 38	\$ (66)	\$ (28)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	1 500	13	13	26	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/06/2028	1 300	(3)	18	15	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2024	11 100	140	(56)	84	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	10 600	(171)	186	15	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2027	9 100	(564)	468	(96)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	5 100	(1)	17	16	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	1 500	(1)	13	12	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	4 100	(15)	58	43	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2027	200	(1)	3	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2028	2 700	(54)	51	(3)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	37 300	105	548	653	0,02
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/12/2026	3 000	(10)	61	51	0,00
MYI	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2024	18 000	98	38	136	0,01
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	2 700	23	24	47	0,00
					\$ (2 952)	\$ 7 282	\$ 4 330	0,13

(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
BOA	07/2023	€ 476	\$ 520	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2023	¥ 900	6	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 3 298	£ 2 608	17	0	17	0,00
	09/2023	NGN 211 518	\$ 365	97	0	97	0,00
	09/2023	\$ 36	NGN 27 936	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07/2023	€ 253	\$ 276	0	0	0	0,00
	07/2023	ILS 61 760	19 366	2 724	0	2 724	0,08
	07/2023	\$ 53	BRL 256	0	0	0	0,00
	07/2023	248 363	€ 226 681	0	(1 054)	(1 054)	(0,03)
	07/2023	52 281	ILS 174 905	0	(5 150)	(5 150)	(0,15)
	07/2023	15 826	¥ 2 199 787	0	(606)	(606)	(0,02)
	07/2023	26	MYR 120	0	0	0	0,00
	08/2023	BRL 256	\$ 53	0	0	0	0,00
	08/2023	CNH 27 980	4 049	190	0	190	0,01
	08/2023	COP 20 000 000	4 360	0	(354)	(354)	(0,01)
	08/2023	€ 223 228	244 935	1 059	0	1 059	0,03
	08/2023	MYR 108 777	23 416	40	0	40	0,00
	08/2023	\$ 11	CNY 75	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	56 943	ILS 190 199	0	(5 653)	(5 653)	(0,17)
	08/2023	ZAR 255 815	\$ 13 746	260	0	260	0,01
	09/2023	\$ 4 336	INR 356 455	0	(3)	(3)	0,00
	12/2023	NGN 55 080	\$ 68	1	0	1	0,00
	12/2023	\$ 167	MXN 2 981	1	0	1	0,00
BRC	07/2023	21	MYR 98	0	0	0	0,00
	08/2023	COP 43 628 519	\$ 10 241	0	(78)	(78)	0,00
	08/2023	ZAR 514 494	27 404	428	(145)	283	0,01
	09/2023	ILS 409	114	4	0	4	0,00
	09/2023	ZAR 347 160	19 656	1 406	0	1 406	0,04
	10/2023	MXN 280 418	14 966	0	(1 069)	(1 069)	(0,03)
CBK	07/2023	CZK 11 852	540	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	€ 17 656	19 026	0	(237)	(237)	(0,01)
	07/2023	ILS 113 145	35 324	4 835	0	4 835	0,14
	07/2023	\$ 2 816	€ 2 624	47	0	47	0,00
	07/2023	160	MXN 2 891	8	0	8	0,00
	08/2023	CNH 29	\$ 4	0	0	0	0,00
	08/2023	COP 28 384 920	6 713	1	(2)	(1)	0,00
	08/2023	ILS 190 199	58 940	7 650	0	7 650	0,22
	09/2023	COP 6 036 493	1 429	13	0	13	0,00
	10/2023	\$ 431	NGN 257 586	0	(112)	(112)	0,00
	11/2023	ILS 147 240	\$ 44 097	4 158	0	4 158	0,12
	11/2023	\$ 2 209	EGP 71 296	0	(152)	(152)	(0,01)
DUB	10/2023	ZAR 123 036	\$ 6 756	311	0	311	0,01
	11/2023	EGP 98 621	3 471	627	0	627	0,02
	01/2024	NGN 135 300	220	58	0	58	0,00
GLM	07/2023	BRL 97 666	19 868	0	(378)	(378)	(0,01)
	07/2023	DOP 802 203	13 855	0	(501)	(501)	(0,02)
	07/2023	ILS 23 207	6 893	635	0	635	0,02

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
	07/2023	\$	BRL	\$ 1 974	\$ 0	\$ 1 974	0,06
	08/2023	DOP	\$	8 139	(100)	(68)	0,00
	09/2023	\$	BRL	81 837	13	13	0,00
	10/2023	DOP	\$	4 978	0	32	0,00
	10/2023	NGN		842	219	0	0,01
	11/2023	DOP		5 474	118	0	0,00
	11/2023	EGP		1 150	215	0	0,01
	11/2023	\$	EGP	86 895	(342)	(342)	(0,01)
	12/2023	DOP	\$	3 154	74	0	0,00
JPM	07/2023	¥		5 236	55	0	0,00
	07/2023	MXN		38	0	0	0,00
	07/2023	\$	NGN	154 832	(82)	(82)	0,00
	08/2023	BRL	\$	17 044	(977)	(977)	(0,03)
	08/2023	CNH		3 250	153	0	0,00
	08/2023	COP	16 649 644	3 927	(27)	(27)	0,00
	08/2023	MXN		18 080	(37)	(37)	0,00
	08/2023	\$	CNY	79	(1)	(1)	0,00
	08/2023		HUF	105 169	3	3	0,00
	08/2023		¥	745 640	(55)	(55)	0,00
	09/2023	COP	14 897 873	3 488	(7)	(7)	0,00
	09/2023	ILS		393	4	4	0,00
	09/2023	PEN		7 439	(72)	(72)	0,00
	09/2023	\$	NGN	183 604	(77)	(77)	0,00
	10/2023			244 639	(91)	(91)	0,00
	12/2023	NGN	\$	400	97	97	0,00
	12/2023	\$	NGN	303 360	(110)	(110)	0,00
MBC	01/2024			66 987	(1)	(1)	0,00
	07/2023	€	\$	4 805	(88)	(88)	0,00
	07/2023	£		24 801	(671)	(671)	(0,02)
	09/2023	\$	INR	999 110	(7)	(7)	0,00
MYI	07/2023	AUD	\$	1	0	0	0,00
	07/2023	£		4	0	0	0,00
	07/2023	\$	€	148	0	0	0,00
	07/2023		£	255	2	2	0,00
	08/2023		ZAR	49 273	(94)	(94)	0,00
	09/2023	AED	\$	10 260	0	0	0,00
	11/2023	EGP		1 012	188	188	0,01
	01/2024	NGN		525	139	139	0,00
	08/2023	\$	MXN	278 106	37	37	0,00
SCX	07/2023	NGN	\$	359	114	114	0,00
	07/2023	\$	€	266	0	0	0,00
	07/2023		MYR	122	0	0	0,00
	07/2023		NGN	34 560	0	0	0,00
	08/2023	CNH	\$	1 547	79	79	0,00
	01/2024	\$	NGN	457 854	(10)	(10)	0,00
SOG	07/2023	€	\$	220 240	(3 125)	(3 125)	(0,09)
	07/2023	PLN		153	(9)	(9)	0,00
TOR	07/2023	\$	£	17 427	11	11	0,00
	08/2023	£	\$	22 149	(11)	(11)	0,00
	08/2023	\$	HUF	66 613	2	2	0,00
UAG	07/2023	€	\$	1 831	(36)	(36)	0,00
	07/2023	\$	SGD	15	0	0	0,00
	07/2023		TRY	22 691	(121)	(121)	0,00
	09/2023	ILS	\$	95	3	3	0,00
	09/2023	\$	SGD	25	0	0	0,00
	09/2023	ZAR	\$	2 654	208	208	0,01
	10/2023			2 142	65	65	0,00
				\$ 28 408	\$ (21 651)	\$ 6 757	0,20

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	\$	78	0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$	AUD	399	(1)	1	0,00
	08/2023			118	0	0	0,00
BOA	07/2023			465	(2)	3	0,00
BPS	07/2023	AUD	\$	408	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$	AUD	90	(1)	(1)	0,00
	08/2023			603	2	2	0,00
CBK	07/2023			103	1	1	0,00
JPM	07/2023			154	2	2	0,00
RBC	07/2023			100	(2)	(2)	0,00
SCX	07/2023	AUD	\$	138	0	0	0,00
	07/2023	\$	AUD	123	2	2	0,00
	08/2023			208	0	0	0,00
SOG	07/2023			245	3	3	0,00
TOR	07/2023	AUD	\$	240	(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
	07/2023	\$ 170	AUD 260	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	08/2023	\$ 240	363	2	0	2	0,00
UAG	07/2023	AUD 699	\$ 464	1	(2)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 82	AUD 126	1	0	1	0,00
	08/2023	464	699	2	(1)	1	0,00
				\$ 26	\$ (13)	\$ 13	0,00

Au 30 juin 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
BPS	07/2023	CHF 23 912	\$ 26 737	\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,00
	07/2023	\$ 34 819	CHF 31 500	391	0	391	0,01
	08/2023	26 737	23 844	0	(9)	(9)	0,00
CLY	07/2023	CHF 12 638	\$ 14 070	0	(57)	(57)	0,00
	08/2023	\$ 14 070	CHF 12 602	57	0	57	0,00
MBC	07/2023	608	546	2	0	2	0,00
MYI	07/2023	CHF 658	\$ 726	0	(9)	(9)	0,00
	07/2023	\$ 1	CHF 1	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	25 034	22 494	109	0	109	0,01
UAG	07/2023	CHF 24 696	\$ 27 549	0	(54)	(54)	0,00
	07/2023	\$ 22 576	CHF 20 286	98	0	98	0,00
	08/2023	27 549	24 625	54	0	54	0,00
				\$ 720	\$ (129)	\$ 591	0,02

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$ 440 629	€ 409 994	\$ 6 675	\$ (1)	\$ 6 674	0,20
BPS	07/2023	€ 414 754	\$ 454 446	1 949	0	1 949	0,06
	07/2023	\$ 439 456	€ 408 793	6 537	0	6 537	0,19
	08/2023	455 044	414 717	0	(1 968)	(1 968)	(0,06)
CBK	07/2023	€ 408 820	\$ 444 295	0	(1 728)	(1 728)	(0,05)
	07/2023	\$ 19 107	€ 17 470	4	(51)	(47)	0,00
	08/2023	430 473	395 389	1 487	0	1 487	0,04
JPM	07/2023	€ 414 649	\$ 452 755	373	0	373	0,01
	07/2023	\$ 22 319	€ 20 875	456	0	456	0,01
	08/2023	453 389	414 649	0	(387)	(387)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 28 027	\$ 30 074	0	(503)	(503)	(0,01)
	07/2023	\$ 407	€ 371	0	(2)	(2)	0,00
SOG	07/2023	439 704	408 746	6 238	0	6 238	0,18
				\$ 23 719	\$ (4 640)	\$ 19 079	0,56

Au 30 juin 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	07/2023	£ 168	\$ 212	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$ 114	£ 90	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	£ 358	\$ 444	0	(11)	(11)	0,00
	07/2023	\$ 19 068	£ 15 417	531	0	531	0,02
BRC	07/2023	£ 205	\$ 259	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07/2023	283	360	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 31	£ 25	0	0	0	0,00
JPM	07/2023	£ 15 265	\$ 19 301	0	(106)	(106)	0,00
	08/2023	\$ 19 305	£ 15 265	106	0	106	0,00
MBC	07/2023	£ 510	\$ 652	4	0	4	0,00
	07/2023	\$ 19 395	£ 15 666	522	0	522	0,01
MYI	07/2023	£ 16	\$ 19	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 19 115	£ 15 380	438	0	438	0,01
TOR	07/2023	£ 15 303	\$ 19 446	0	(10)	(10)	0,00
	08/2023	\$ 19 450	£ 15 303	10	0	10	0,00
				\$ 1 611	\$ (130)	\$ 1 481	0,04

Au 30 juin 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
BRC	07/2023	\$ 8 661	SGD 11 719	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
GLM	07/2023	SGD 613	\$ 457	4	0	4	0,00
	07/2023	\$ 217	SGD 294	0	0	0	0,00
JPM	07/2023	SGD 11 744	\$ 8 678	1	0	1	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		
	07/2023	\$	1 202	SGD	1 627	\$ 0	\$ 0	0,00	
	08/2023		8 678		11 732	0	(1)	0,00	
MBC	07/2023		7 886		10 655	0	(13)	0,00	
	08/2023		11		15	0	0	0,00	
MYI	07/2023	SGD	11 385	\$	8 426	13	0	13	
	08/2023	\$	8 426	SGD	11 374	0	(13)	(13)	
UAG	07/2023	SGD	21	\$	16	0	0	0,00	
	07/2023	\$	8 512	SGD	11 515	0	(4)	(4)	
						\$ 18	\$ (32)	\$ (14)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 34 134 1,01

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	
CERTIFICATS DE DÉPÔT				
Banco Davivienda S.A. 13,501 % éch. 13/12/2024	COP	15 106 000	\$ 3 617	0,11
15,389 % éch. 21/02/2024		4 622 500	1 123	0,03
Bancolombia S.A. 5,917 % éch. 27/01/2024		21 517 000	4 960	0,15
13,320 % éch. 08/06/2025		7 817 000	1 879	0,06
13,637 % éch. 14/12/2024		20 654 000	4 975	0,15
16,137 % éch. 01/09/2024		8 476 000	2 053	0,06
BBVA Colombia S.A. 5,870 % éch. 15/07/2024		17 362 000	3 906	0,11
14,540 % éch. 13/01/2024		9 047 900	2 149	0,06
16,412 % éch. 25/04/2024		334 000	78	0,00
Total des Certificats de dépôt		\$ 24 740		0,73
Total des Investissements		\$ 3 431 262		101,23
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (41 615)		(1,23)
Actifs nets		\$ 3 389 647		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) 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 : 0,89 %) :

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	\$ 460	\$ 460	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. « D » - Exp. 10/06/2071	10/06/2022	0	0	0,00
Development Bank of Southern Africa 8,600 % éch. 21/10/2024	07/10/2021	31 381	24 311	0,72
DrillCo Holding Lux S.A.	08/06/2023	7 281	6 989	0,21
		\$ 39 122	\$ 31 760	0,94

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 56 824 \$ (31 décembre 2022 : 84 485 \$) et un montant en numéraire de 520 \$ (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 30 juin 2023.

Un titre d'une juste valeur globale de 22 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 0 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 19 480 \$ (31 décembre 2022 : 36 243 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 1 880 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 3 264 035	\$ 84 211	\$ 3 348 247
Fonds d'investissement	30 285	0	0	30 285
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(254)	27 747	497	27 990
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	8 310	16 430	24 740
Totaux	\$ 30 032	\$ 3 300 092	\$ 101 138	\$ 3 431 262

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 30 juin 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	5,450 %	17/04/2023	18/07/2023	\$ (17 391)	\$ (17 588)	(0,52)
	5,450	17/05/2023	18/07/2023	(12 705)	(12 791)	(0,38)
BRC	2,000	05/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(3 019)	(3 037)	(0,09)
	3,750	05/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(9 056)	(9 110)	(0,27)
	4,800	05/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(1 579)	(1 588)	(0,05)
	8,750	05/10/2022	TBD ⁽¹⁾	ZAR (125 726)	(7 048)	(0,21)
MBC	2,800	03/07/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (361)	(394)	(0,01)
	3,750	30/06/2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (1 582)	(1 583)	(0,04)
	4,700	30/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(1 323)	(1 324)	(0,04)
NOM	4,900	22/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(449)	(449)	(0,01)
Total Reverse Repurchase Agreements					\$ (54 912)	(1,62)

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 0	\$ 1	\$ 2	\$ 0	\$ 2
BOA	7 790	(6 230)	1 560	(9 485)	8 490	(995)
BPS	(167)	920	753	1 829	(690)	1 139
BRC	411	250	661	(897)	860	(37)
CBK	17 475	(16 700)	775	20 215	(19 290)	925
CLY	S/O	S/O	S/O	(454)	0	(454)
DUB	1 494	(1 660)	(166)	126	(230)	(104)
FBF	S/O	S/O	S/O	(33)	0	(33)
GLM	1 959	(1 770)	189	46	(120)	(74)
GST	313	(300)	13	(1 298)	1 330	32
HUS	36	(150)	(114)	58	(150)	(92)
IND	S/O	S/O	S/O	0	270	270
JPM	343	(270)	73	1 107	(1 310)	(203)
MBC	(756)	710	(46)	3 472	(2 910)	562
MYC	869	(880)	(11)	(27)	(60)	(87)
MYI	711	(790)	(79)	70	(160)	(90)
RBC	35	0	35	1	0	1
RYL	S/O	S/O	S/O	1 375	(1 300)	75
SCX	294	(280)	14	8 586	(8 150)	436
SOG	3 107	(2 300)	807	(37)	0	(37)
TOR	5	0	5	8	(20)	(12)
UAG	214	0	214	(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.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	87,53	83,54
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	10,96	15,12
Autres valeurs mobilières	0,29	0,17
Fonds d'investissement	0,89	1,60
Contrats de mise en pension	S/O	0,28
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,16)	0,01
Instruments financiers dérivés compensés	(0,02)	(0,14)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,01	0,73
Certificats de dépôt	0,73	0,07
Contrats de prise en pension	(1,62)	(2,28)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Albanie	0,09	0,09
Angola	0,42	0,19
Argentine	1,98	1,46
Azerbaïdjan	1,16	1,31
Bahamas	0,36	0,36
Bahreïn	0,33	0,36
Biélorussie	S/O	0,02
Bénin	0,10	0,18
Bésil	1,60	2,04
Cameroun	0,18	0,18
Canada	0,03	S/O
Îles Caïmans	2,96	3,52
Chili	2,52	2,67
Chine	0,25	0,32
Colombie	2,17	2,78
Costa Rica	0,08	0,27
République dominicaine	3,96	2,69
Équateur	0,74	1,11
Égypte	1,82	2,10
Salvador	0,39	0,28
Éthiopie	0,07	0,06
Gabon	0,02	S/O
Géorgie	0,01	0,01
Allemagne	S/O	0,33
Ghana	0,58	0,74
Guatemala	0,88	0,68
Hong Kong	1,13	0,83
Hongrie	2,10	0,96
Inde	0,25	0,30
Indonésie	4,22	4,75
Internationales	0,24	S/O
Irlande	0,73	0,73
Israël	2,02	1,74
Côte d'Ivoire	0,36	0,67
Jamaïque	0,08	0,08
Japon	0,48	0,50
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,73	0,71
Jordanie	0,88	0,72
Kazakhstan	1,13	1,37
Kenya	0,14	0,03
Liban	0,02	0,02
Luxembourg	1,61	0,45
Macédoine du nord	0,25	S/O
Malaisie	1,42	0,33
Île Maurice	0,01	0,08
Mexique	7,62	6,66
Mongolie	S/O	0,05
Maroc	0,36	0,51
Multinationales	0,27	0,28
Namibie	0,17	0,17
Pays-Bas	0,60	0,61
Nigeria	1,92	1,62
Oman	1,62	1,73
Pakistan	0,35	0,34
Panama	1,97	1,59
Paraguay	0,45	0,35
Pérou	1,52	1,17
Philippines	0,60	0,42
Pologne	1,00	0,38
Qatar	2,04	1,66
Roumanie	2,15	1,80
Russie	0,28	0,22
Arabie saoudite	4,45	2,32
Sénégal	0,44	0,23
Serbie	1,03	0,69

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Singapour	0,54	0,50
Afrique du Sud	4,68	4,48
Corée du Sud	0,66	S/O
Espagne	0,39	0,41
Sri Lanka	0,75	0,50
Supranationales	0,21	0,21
Suisse	0,34	0,82
Tanzanie	0,36	0,50
Thaïlande	0,06	0,10
Tunisie	0,24	0,28
Turquie	5,22	5,16
Ukraine	0,29	0,27
Émirats arabes unis	2,29	1,89
Royaume-Uni	1,40	2,07
États-Unis	11,13	9,86
Ouzbékistan	0,20	0,21
Venezuela	0,34	0,40
Vietnam	0,01	0,02
Îles Vierges britanniques	0,13	0,64
Zambie	0,10	0,11
Instruments à court terme	0,10	9,58
Fonds d'investissement	0,89	1,60
Contrats de mise en pension	S/O	0,28
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,16)	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 - achat de protection	(0,01)	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	(0,02)
Swaps de taux d'intérêt	(0,01)	(0,12)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,06	0,08
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,13	(0,11)
Swaps de volatilité	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,20	(0,14)
Contrats de change à terme couverts	0,62	0,90
Certificats de dépôt	0,73	0,07
Autres actifs et passifs à court terme	(1,23)	(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
VALEURS MOBILIÈRES			
ARGENTINE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement argentin			
0,500 % éch. 09/07/2030	\$ 20 662	\$ 6 900	0,29
1,000 % éch. 09/07/2029	7 494	2 450	0,10
1,500 % éch. 09/07/2035	25 179	7 594	0,32
3,500 % éch. 09/07/2041	102 729	33 081	1,40
3,875 % éch. 09/01/2038	11 113	3 927	0,17
Provincia de la Rioja			
6,500 % éch. 24/02/2028 ^	425	227	0,01
Provincia de Neuquen			
6,625 % éch. 27/04/2030 ^	320	228	0,01
Total Argentine		54 407	2,30
ARMÉNIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement de la République d'Arménie			
3,600 % éch. 02/02/2031	7 700	6 055	0,25
3,950 % éch. 26/09/2029	800	666	0,03
Total Arménie		6 721	0,28
BAHAMAS			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement des Bahamas			
6,000 % éch. 21/11/2028	6 700	5 411	0,23
9,000 % éch. 16/06/2029	3 400	3 025	0,13
Total Bahamas		8 436	0,36
BAHREIN			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement bahreïni			
4,250 % éch. 25/01/2028	15 000	13 873	0,59
5,250 % éch. 25/01/2033	3 000	2 619	0,11
5,625 % éch. 30/09/2031	5 900	5 471	0,23
6,000 % éch. 19/09/2044	1 300	1 038	0,04
Total Bahrein		23 001	0,97
BÉNIN			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement du Bénin			
4,950 % éch. 22/01/2035	€ 13 500	10 449	0,44
BERMUDES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Star Energy Geothermal Darajat			
4,850 % éch. 14/10/2038	\$ 3 800	3 442	0,15
BRÉSIL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais			
5,333 % éch. 15/02/2028	11 305	11 105	0,47
CSN Inova Ventures			
6,750 % éch. 28/01/2028	8 500	7 894	0,33
Rede D'or Finance SARL			
4,500 % éch. 22/01/2030	263	224	0,01
Suzano Austria GmbH			
3,125 % éch. 15/01/2032	3 000	2 403	0,10
		21 626	0,91
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement brésilien			
4,250 % éch. 07/01/2025	300	295	0,01
4,750 % éch. 14/01/2050	21 275	15 716	0,67
5,000 % éch. 27/01/2045	5 395	4 219	0,18
		20 230	0,86
Total Brésil		41 856	1,77
BULGARIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement bulgare			
4,500 % éch. 27/01/2033	€ 5 400	5 848	0,25

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÎLES CAÏMANS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AAC Technologies Holdings, Inc.			
2,625 % éch. 02/06/2026	\$ 6 800	\$ 5 960	0,25
Alibaba Group Holding Ltd.			
2,700 % éch. 09/02/2041	5 000	3 344	0,14
Baidu, Inc.			
2,375 % éch. 23/08/2031	1 900	1 537	0,07
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.			
0,000 % éch. 05/06/2034 (b)	4 809	3 365	0,14
CIFI Holdings Group Co. Ltd.			
4,450 % éch. 17/08/2026 ^	2 900	329	0,01
Country Garden Holdings Co. Ltd.			
2,700 % éch. 12/07/2026	2 300	704	0,03
3,875 % éch. 22/10/2030	1 800	515	0,02
Hongkong Land Finance Cayman Islands Co. Ltd.			
2,250 % éch. 15/07/2031	13 000	10 640	0,45
ICD Funding Ltd.			
3,223 % éch. 28/04/2026	400	374	0,02
IHS Holding Ltd.			
5,625 % éch. 29/11/2026	1 500	1 313	0,06
Interoceanica Finance Ltd.			
0,000 % éch. 30/11/2025 (b)	338	311	0,01
7,860 % éch. 15/05/2030	2 655	2 522	0,11
Kaisa Group Holdings Ltd.			
9,375 % éch. 30/06/2024 ^	1 850	123	0,01
9,750 % éch. 28/09/2023 ^	300	20	0,00
11,250 % éch. 09/04/2022 ^	1 000	67	0,00
11,500 % éch. 30/01/2023 ^	200	13	0,00
11,650 % éch. 01/06/2026 ^	3 600	241	0,01
11,700 % éch. 11/11/2025 ^	1 450	97	0,00
11,950 % éch. 12/11/2023 ^	300	24	0,00
Lima Metro Line Finance Ltd.			
5,875 % éch. 05/07/2034	459	447	0,02
MAF Sukuk Ltd.			
4,638 % éch. 14/05/2029	3 600	3 526	0,15
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.			
5,950 % éch. 30/04/2025	3 400	352	0,02
Sunac China Holdings Ltd.			
5,950 % éch. 26/04/2024 ^	1 500	225	0,01
6,500 % éch. 10/01/2025 ^	700	106	0,00
7,000 % éch. 09/07/2025 ^	3 500	529	0,02
Xiaomi Best Time International Ltd.			
4,100 % éch. 14/07/2051	11 900	7 054	0,30
Zhongsheng Group Holdings Ltd.			
3,000 % éch. 13/01/2026	1 000	912	0,04
Total Îles Caïmans		44 650	1,89
CHILI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Santander Chile			
2,700 % éch. 10/01/2025	2 250	2 153	0,09
Corp. Nacional del Cobre de Chile			
3,150 % éch. 14/01/2030	1 050	932	0,04
3,625 % éch. 01/08/2027	600	567	0,02
3,700 % éch. 30/01/2050	700	531	0,02
4,375 % éch. 05/02/2049	200	169	0,01
4,500 % éch. 01/08/2047	500	427	0,02
4,875 % éch. 04/11/2044	300	271	0,01
5,125 % éch. 02/02/2033	3 900	3 851	0,16
Empresa de los Ferrocarriles del Estado			
3,068 % éch. 18/08/2050	600	367	0,02
3,830 % éch. 14/09/2061	2 300	1 569	0,07
Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.			
4,250 % éch. 07/05/2029	1 600	1 524	0,06
		12 361	0,52
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement chilien			
2,550 % éch. 27/01/2032 (g)	4 000	3 425	0,15
3,100 % éch. 07/05/2041	15 400	11 596	0,49
3,100 % éch. 22/01/2061	7 900	5 180	0,22
3,250 % éch. 21/09/2071	4 800	3 126	0,13
3,500 % éch. 25/01/2050	5 600	4 220	0,18
3,500 % éch. 15/04/2053 (g)	8 900	6 651	0,28

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,340 % éch. 07/03/2042	\$ 7 700	\$ 6 855	0,29
Total Chili		53 414	2,26
CHINE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Yango Justice International Ltd.			
7,500 % éch. 17/02/2025 ^	3 300	29	0,00
7,875 % éch. 04/09/2024 ^	2 000	30	0,00
Total Chine		59	0,00
COLOMBIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Davivienda S.A.			
6,650 % éch. 22/04/2031 (c)(d)	6 720	4 952	0,21
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement colombien			
3,000 % éch. 30/01/2030	300	234	0,01
3,125 % éch. 15/04/2031	4 200	3 177	0,13
3,875 % éch. 25/04/2027	4 000	3 636	0,15
3,875 % éch. 15/02/2061	9 700	5 454	0,23
4,125 % éch. 15/05/2051 (g)	18 300	10 997	0,47
4,500 % éch. 28/01/2026	5 200	4 963	0,21
5,000 % éch. 15/06/2045	1 100	769	0,03
5,200 % éch. 15/05/2049	7 700	5 309	0,22
5,625 % éch. 26/02/2044	1 000	747	0,03
6,125 % éch. 18/01/2041	1 300	1 062	0,05
7,375 % éch. 18/09/2037	3 865	3 682	0,16
7,500 % éch. 02/02/2034	12 510	12 265	0,52
8,000 % éch. 20/04/2033	5 000	5 086	0,22
10,375 % éch. 28/01/2033	1 350	1 561	0,07
		58 942	2,50
Total Colombie		63 894	2,71
COSTA RICA			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement costaricain			
5,625 % éch. 30/04/2043	18 950	16 327	0,69
6,550 % éch. 03/04/2034	1 500	1 508	0,07
7,158 % éch. 12/03/2045 (g)	2 400	2 383	0,10
Total Costa Rica		20 218	0,86
CHYPRE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Atrium Finance PLC			
2,625 % éch. 05/09/2027	€ 8 000	6 363	0,27
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Billets de la Banque centrale de République dominicaine			
12,000 % éch. 03/10/2025	DOP 36 900	701	0,03
13,000 % éch. 05/12/2025	647 400	12 630	0,54
13,000 % éch. 30/01/2026	222 500	4 353	0,18
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine			
4,500 % éch. 30/01/2030	\$ 3 000	2 637	0,11
5,300 % éch. 21/01/2041	8 800	6 917	0,29
5,500 % éch. 27/01/2025	2 500	2 464	0,10
5,500 % éch. 22/02/2029	11 200	10 508	0,45
5,875 % éch. 30/01/2060	32 500	25 267	1,07
5,950 % éch. 25/01/2027	8 400	8 254	0,35
6,000 % éch. 19/07/2028	1 520	1 485	0,06
6,000 % éch. 22/02/2033	1 700	1 572	0,07
6,400 % éch. 05/06/2049	2 500	2 136	0,09
6,500 % éch. 15/02/2048	200	173	0,01
6,850 % éch. 27/01/2045	3 100	2 822	0,12
6,875 % éch. 29/01/2026	4 500	4 543	0,19
13,625 % éch. 03/02/2033	DOP 500 900	11 263	0,48
13,625 % éch. 10/02/2034	277 400	6 335	0,27
Total République dominicaine		104 060	4,41

DESCRIPTION	VALEUR	JUSTE EN % DE	
	NOMINALE	VALEUR	L'ACTIF
ÉQUATEUR	(en milliers)	(en milliers)	NET

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Ecuador Social Bond SARL			
0,000 % éch. 30/01/2035 (b)	\$ 11 937	\$ 9 073	0,38

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement d'Équateur			
0,000 % éch. 31/07/2030 (b)	5 886	1 712	0,07
1,500 % éch. 31/07/2040	4 527	1 419	0,06
2,500 % éch. 31/07/2035	56 088	19 627	0,83
5,500 % éch. 31/07/2030	11 934	5 802	0,25

Total Équateur

37 633 1,59

ÉGYPTE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement égyptien			
5,250 % éch. 06/10/2025	7 500	5 728	0,24
5,625 % éch. 16/04/2030	1 100	668	0,03
5,875 % éch. 16/02/2031	\$ 3 800	2 102	0,09
6,375 % éch. 11/04/2031	€ 11 200	6 821	0,29
7,053 % éch. 15/01/2032	\$ 6 200	3 532	0,15
7,300 % éch. 30/09/2033	6 000	3 320	0,14
7,500 % éch. 16/02/2061	8 400	4 236	0,18
7,625 % éch. 29/05/2032	8 800	5 135	0,22
7,903 % éch. 21/02/2048	4 300	2 220	0,09
8,150 % éch. 20/11/2059	3 500	1 822	0,08
8,500 % éch. 31/01/2047	3 400	1 815	0,07
8,750 % éch. 30/09/2051	7 400	4 012	0,17

Total Égypte

41 411 1,75

SALVADOR

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement salvadorien			
6,375 % éch. 18/01/2027	3 600	2 529	0,11
7,125 % éch. 20/01/2050	14 900	8 329	0,35
7,625 % éch. 21/09/2034	1 100	644	0,03
7,625 % éch. 01/02/2041	250	143	0,01
7,650 % éch. 15/06/2035	1 000	594	0,02
9,500 % éch. 15/07/2052	7 750	4 914	0,21

Total Salvador

17 153 0,73

GABON

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement gabonais			
6,625 % éch. 06/02/2031	600	479	0,02
7,000 % éch. 24/11/2031	1 300	1 035	0,04

Total Gabon

1 514 0,06

GEORGIE

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Georgian Railway JSC			
4,000 % éch. 17/06/2028	10 700	9 279	0,39

GHANA

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement du Ghana			
0,000 % éch. 07/04/2025 ^	1 400	539	0,02
7,625 % éch. 16/05/2029 ^	3 300	1 422	0,06
7,750 % éch. 07/04/2029 ^	2 700	1 162	0,05
7,875 % éch. 11/02/2035 ^	5 700	2 494	0,11
8,125 % éch. 26/03/2032 ^	11 300	4 882	0,21
8,625 % éch. 07/04/2034 ^	7 900	3 403	0,14
8,627 % éch. 16/06/2049 ^	1 600	663	0,03
8,750 % éch. 11/03/2061 ^	31 850	13 287	0,56
8,875 % éch. 07/05/2042 ^	1 100	455	0,02
8,950 % éch. 26/03/2051 ^	6 700	2 810	0,12

Total Ghana

31 117 1,32

GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
2,950 % éch. 29/07/2026	€ 3 500	2 879	0,12

DESCRIPTION	VALEUR	JUSTE EN % DE	
	NOMINALE	VALEUR	L'ACTIF
HONG KONG	(en milliers)	(en milliers)	NET

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

AIA Group Ltd.			
3,200 % éch. 16/09/2040	\$ 200	\$ 154	0,01
Fortune Star BVI Ltd.			
3,950 % éch. 02/10/2026	€ 1 500	1 129	0,04
5,000 % éch. 18/05/2026	\$ 200	150	0,01
5,050 % éch. 27/01/2027	200	138	0,01
5,950 % éch. 19/10/2025	4 000	3 206	0,13
Huarong Finance Co. Ltd.			
3,875 % éch. 13/11/2029	900	695	0,03
4,500 % éch. 29/05/2029	4 200	3 371	0,14
4,750 % éch. 27/04/2027	800	693	0,03
4,950 % éch. 07/11/2047	1 700	1 134	0,05

Total Hong Kong

46 354 1,96

LENOVO

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Lenovo Group Ltd.			
3,421 % éch. 02/11/2030	1 500	1 265	0,05
6,536 % éch. 27/07/2032	6 800	6 865	0,29

Total Lenovo

8 300 0,34

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Airport Authority Hong Kong			
2,100 % éch. 08/03/2026 (c)	1 800	1 647	0,07
2,400 % éch. 08/03/2028 (c)	3 600	3 173	0,13
2,500 % éch. 12/01/2032	200	170	0,01
4,875 % éch. 12/01/2030	6 500	6 610	0,28

Total Hong Kong

12 200 0,50

2 375 % éch. 02/02/2051 1 200 816 0,03

3,750 % éch. 07/06/2032 € 5 500 6 044 0,26

5,250 % éch. 11/01/2053 \$ 3 500 3 916 0,17

22 376 0,95

Total Hong Kong 46 354 1,96

HONGRIE

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

MVM Energetika Zrt			
7,500 % éch. 09/06/2028	4 400	4 392	0,18

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Banque de développement hongroise			
6,500 % éch. 29/06/2028	10 900	10 810	0,46

Total Hongrie

15 200 0,62

Obligation internationale du gouvernement hongrois

1,625 % éch. 28/04/2032 € 1 200 997 0,04

1,750 % éch. 05/06/2035 8 400 6 439 0,27

2,125 % éch. 22/09/2031 \$ 18 650 14 460 0,61

3,125 % éch. 21/09/2051 7 600 4 742 0,20

5,250 % éch. 16/06/2029 11 600 11 311 0,48

5,375 % éch. 25/03/2024 200 200 0,01

5,500 % éch. 16/06/2034 1 700 1 655 0,07

6,750 % éch. 25/09/2052 16 600 17 168 0,73

7,625 % éch. 29/03/2041 500 565 0,02

Magyar Export-Import Bank

6,125 % éch. 04/12/2027 7 500 7 428 0,32

75 775 3,21

Total Hongrie 80 167 3,39

INDE

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Adani Renewable Energy RJ Ltd.			
4,625 % éch. 15/10/2039	3 916	2 871	0,12

Total Inde

10 300 0,43

Indian Railway Finance Corp. Ltd.

3,570 % éch. 21/01/2032 10 300 8 989 0,38

3,835 % éch. 13/12/2027 3 500 3 269 0,14

JSW Hydro Energy Ltd.

4,125 % éch. 18/05/2031 3 990 3 370 0,14

ReNew Power Pvt Ltd.

5,875 % éch. 05/03/2027 1 202 1 127 0,05

ReNew Wind Energy AP2

4,500 % éch. 14/07/2028 10 000 8 532 0,36

Wipro IT Services LLC

1,500 % éch. 23/06/2026 5 000 4 461 0,19

Total Inde 32 619 1,38

DESCRIPTION	VALEUR	JUSTE EN % DE	
	NOMINALE	VALEUR	L'ACTIF
INDONÉSIE	(en milliers)	(en milliers)	NET

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Bank Mandiri Persero Tbk PT			
2,000 % éch. 19/04/2026	\$ 6 700	\$ 6 060	0,26
3,750 % éch. 11/04/2024	2 000	1 967	0,08
Pelabuhan Indonesia Persero PT			
4,250 % éch. 05/05/2025	6 700	6 539	0,28
5,375 % éch. 05/05/2045	3 000	2 832	0,12
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
4,700 % éch. 06/06/2032	18 100	17 975	0,76

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement indonésien			
1,100 % éch. 12/03/2033	€ 1 700	1 381	0,06
1,300 % éch. 23/03/2034	11 400	9 184	0,39
4,750 % éch. 18/07/2047	\$ 4 400	4 159	0,17
5,125 % éch. 15/01/2045	4 164	4 152	0,17
5,250 % éch. 08/01/2047	200	200	0,01
5,650 % éch. 11/01/2053	700	734	0,03
7,750 % éch. 17/01/2038	3 280	4 107	0,17
8,500 % éch. 12/10/2035	1 055	1 376	0,06

Total Indonésie

67 628 2,86

Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia

3,550 % éch. 09/06/2051 5 500 4 191 0,18

3,800 % éch. 23/06/2050 3 500 2 771 0,12

32 255 1,36

Total Indonésie 67 628 2,86

INTERNATIONALES

CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS

Project Mercury			
TBD % éch. 17/07/2030	€ 4 800	5 237	0,22

IRLANDE

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC			
5,950 % éch. 15/04/2030 ^ (d)	\$ 3 900	234	0,01

Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC

3,949 % éch. 24/04/2023 ^ 1 700 1 556 0,06

Sovcombank Via SovCom Capital DAC

3,400 % éch. 26/01/2025 ^ 5 400 146 0,01

Total Irlande 1 936 0,08

CÔTE D'IVOIRE

CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS

République de Côte d'Ivoire			
7,985 % éch. 19/03/2027	€ 1 200	1 277	0,05

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire			
5,250 % éch. 22/03/2030	19 900	18 401	0,78
5,875 % éch. 17/10/2031	600	549	0,02
6,625 % éch. 22/03/2048	2 900	2 253	0,10

Total Côte d'Ivoire

22 480 0,95

21 203 0,90

22 480 0,95

JAMAÏQUE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement jamaïcain			
7,8			

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
7,375 % éch. 10/10/2047	\$ 7 300	\$ 6 312	0,27
7,500 % éch. 13/01/2029	6 000	6 049	0,26
Total Jordanie		15 599	0,66

KAZAKHSTAN ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement kazakh			
4,875 % éch. 14/10/2044	5 600	5 060	0,21
6,500 % éch. 21/07/2045	21 800	23 068	0,98
Total Kazakhstan		28 128	1,19

KENYA ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement kenyan			
6,300 % éch. 23/01/2034	6 200	4 699	0,20
6,875 % éch. 24/06/2024	9 400	8 964	0,38
Total Kenya		13 663	0,58

LUXEMBOURG OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Amaggi Luxembourg International SARL			
5,250 % éch. 28/01/2028	6 000	5 465	0,23
Unigel Luxembourg S.A.			
8,750 % éch. 01/10/2026	3 400	1 118	0,05
Total Luxembourg		6 583	0,28

MACÉDOINE DU NORD ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du nord			
2,750 % éch. 18/01/2025	€ 3 600	3 749	0,16
5,625 % éch. 26/07/2023	5 800	6 333	0,27
6,960 % éch. 13/03/2027	6 700	7 471	0,31
Total Macédoine du nord		17 553	0,74

MALAISIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Axiata SPV5 Labuan Ltd.			
3,064 % éch. 19/08/2050	\$ 4 600	3 214	0,14
Khazanah Capital Ltd.			
4,876 % éch. 01/06/2033	4 300	4 260	0,18
Khazanah Global Sukuk Bhd.			
4,687 % éch. 01/06/2028	5 800	5 725	0,24
		13 199	0,56

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement malaisien			
3,800 % éch. 17/08/2023	MYR 74 400	15 953	0,67
Total Malaisie		29 152	1,23

ÎLE MAURICE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Greenko Solar Mauritius Ltd.			
5,950 % éch. 29/07/2026	\$ 200	188	0,01
India Green Energy Holdings			
5,375 % éch. 29/04/2024	9 400	9 192	0,39
Total Île Maurice		9 380	0,40

MEXIQUE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Mercantil del Norte S.A.			
6,625 % éch. 24/01/2032 (c)(d)	2 000	1 548	0,07
7,500 % éch. 27/06/2029 (c)(d)	3 400	2 955	0,12
7,625 % éch. 10/01/2028 (c)(d)	300	273	0,01
8,375 % éch. 14/10/2030 (c)(d)	400	374	0,02
Corp. GEO S.A.B. de C.V.			
8,875 % éch. 25/09/2014 ^	500	0	0,00
Metalsa S.A. de C.V.			
3,750 % éch. 04/05/2031	10 600	8 356	0,35
Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V.			
5,375 % éch. 04/04/2032	6 500	5 893	0,25

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Trust Fibra Uno			
6,390 % éch. 15/01/2050	\$ 2 000	\$ 1 584	0,07
		20 983	0,89

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement mexicain			
1,350 % éch. 18/09/2027	€ 600	594	0,03
2,250 % éch. 12/08/2036	9 700	7 852	0,33
2,659 % éch. 24/05/2031	\$ 0	0	0,00
3,750 % éch. 19/04/2071	3 700	2 477	0,11
3,771 % éch. 24/05/2061	0	0	0,00
4,875 % éch. 19/05/2033	18 800	17 974	0,76
5,750 % éch. 12/10/2110	18 340	16 413	0,69
6,338 % éch. 04/05/2053	3 900	3 983	0,17
6,350 % éch. 09/02/2035	0	0	0,00
		49 293	2,09
Total Mexique		70 276	2,98

MONGOLIE ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement mongol			
3,500 % éch. 07/07/2027	7 200	6 022	0,26
5,125 % éch. 07/04/2026	1 100	1 026	0,04
8,650 % éch. 19/01/2028	268	270	0,01
Total Mongolie		7 318	0,31

MAROC ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement marocain			
4,000 % éch. 15/12/2050	17 000	11 471	0,48
5,500 % éch. 11/12/2042	4 600	3 970	0,17
Total Maroc		15 441	0,65

MULTINATIONALES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
NXP BV			
3,400 % éch. 01/05/2030	500	443	0,02

NAMIBIE ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement namibien			
5,250 % éch. 29/10/2025	2 300	2 190	0,09

PAYS-BAS OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
---	--	--	--

IHS Netherlands Holdco BV			
8,000 % éch. 18/09/2027	10 700	9 780	0,41

ING Groep NV			
1,125 % éch. 07/12/2028	£ 4 000	3 992	0,17
1,400 % éch. 01/07/2026	\$ 7 900	7 197	0,31

InterCement Financial Operations BV			
5,750 % éch. 17/07/2024	200	125	0,01

Metinvest BV			
8,500 % éch. 23/04/2026	1 100	759	0,03

NE Property BV			
2,000 % éch. 20/01/2030	€ 5 600	4 521	0,19
3,375 % éch. 14/07/2027	2 300	2 255	0,10

Prosus NV			
1,539 % éch. 03/08/2028	800	720	0,03
2,031 % éch. 03/08/2032	400	311	0,01
3,257 % éch. 19/01/2027	\$ 2 200	1 989	0,08
4,027 % éch. 03/08/2050	800	503	0,02

Total Pays-Bas		32 152	1,36
-----------------------	--	---------------	-------------

OMAN ÉMISSIONS SOUVERAINES			
-------------------------------	--	--	--

Obligation internationale du gouvernement omanais			
4,750 % éch. 15/06/2026	4 600	4 479	0,19
4,875 % éch. 01/02/2025	3 000	2 956	0,13
5,375 % éch. 08/03/2027	5 600	5 504	0,23
5,625 % éch. 17/01/2028	8 200	8 126	0,34
6,000 % éch. 01/08/2029	12 300	12 328	0,52
6,250 % éch. 25/01/2031	6 200	6 303	0,27
6,500 % éch. 08/03/2047	2 650	2 478	0,11
6,750 % éch. 28/10/2027	14 400	14 903	0,63

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
6,750 % éch. 17/01/2048	\$ 6 700	\$ 6 454	0,27
7,000 % éch. 25/01/2051	4 800	4 764	0,20
Total Oman		68 295	2,89

PANAMA OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.			
5,125 % éch. 11/08/2061	2 900	2 239	0,10
Banco General S.A.			
5,250 % éch. 07/05/2031 (c)	6 500	5 620	0,24
Banco Nacional de Panama			
2,500 % éch. 11/08/2030	600	473	0,02
Empresa de Transmision Electrica S.A.			
5,125 % éch. 02/05/2049	1 000	813	0,03
		9 145	0,39

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement panaméen			
2,252 % éch. 29/09/2032	3 300	2 530	0,11
3,160 % éch. 23/01/2030	800	702	0,03
3,870 % éch. 23/07/2060	8 500	5 655	0,24
4,300 % éch. 29/04/2053	1 500	1 120	0,05
4,500 % éch. 15/05/2047	4 200	3 351	0,14
4,500 % éch. 16/04/2050	9 800	7 619	0,32
4,500 % éch. 01/04/2056	15 000	11 302	0,48
4,500 % éch. 19/01/2063	18 500	13 581	0,57
6,400 % éch. 14/02/2035	10 600	11 081	0,47
6,700 % éch. 26/01/2036	6 500	6 976	0,29
6,853 % éch. 28/03/2054	2 700	2 816	0,12
8,125 % éch. 28/04/2034	1 000	1 184	0,05
		67 917	2,87

Total Panama		77 062	3,26
---------------------	--	---------------	-------------

PARAGUAY ÉMISSIONS SOUVERAINES			
-----------------------------------	--	--	--

Obligation internationale du gouvernement paraguayen			
2,739 % éch. 29/01/2033	1 900	1 524	0,06
3,849 % éch. 28/06/2033	1 900	1 654	0,07
4,700 % éch. 27/03/2027	2 300	2 240	0,10
5,400 % éch. 30/03/2050	15 200	13 023	0,55
5,600 % éch. 13/03/2048	1 800	1 583	0,07
5,850 % éch. 21/08/2033 (a)	2 700	2 704	0,11
6,100 % éch. 11/08/2044	1 800	1 709	0,07
Total Paraguay		24 437	1,03

PÉROU OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
--	--	--	--

InRetail Consumer			
3,250 % éch. 22/03/2028	3 700	3 181	0,14

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
-----------------------	--	--	--

Fondo MIVIVIENDA S.A.			
4,625 % éch. 12/04/2027	12 100	11 701	0,49
Obligation internationale du gouvernement péruvien			
1,950 % éch. 17/11/2036	€ 8 300	6 568	0,28
3,000 % éch. 15/01/2034	\$ 7 700	6 416	0,27
3,230 % éch. 28/07/2121	0	0	0,00
3,600 % éch. 15/01/2072	8 200	5 611	0,24
6,550 % éch. 14/03/2037	0	0	0,00
		30 296	1,28

Total Pérou		33 477	1,42
--------------------	--	---------------	-------------

PHILIPPINES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
--	--	--	--

Globe Telecom, Inc.			
4,200 % éch. 02/08/2026 (c)	6 700	6 239	0,27
PLDT, Inc.			
3,450 % éch. 23/06/2050	3 900	2 662	0,11
		8 901	0,38

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
-----------------------	--	--	--

Obligation internationale du gouvernement philippin			
2,650 % éch. 10/12/2045	1 800	1 215	0,05
2,950 % éch. 05/05/2045	10 500	7 496	0,32
3,200 % éch. 06/07/2046	4 200	3 109	0,13

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,700 % éch. 01/03/2041	\$ 300	\$ 247	0,01
5,500 % éch. 17/01/2048	10 600	10 890	0,46
6,375 % éch. 23/10/2034	800	895	0,04
9,500 % éch. 02/02/2030	1 100	1 381	0,06
		25 233	1,07
Total Philippines		34 134	1,45

POLOGNE**ÉMISSIONS SOUVERAINES**

Bank Gospodarstwa Krajowego	3 800	3 785	0,16
Obligation internationale du gouvernement polonais			
4,875 % éch. 04/10/2033	11 200	11 015	0,47
5,500 % éch. 16/11/2027	6 700	6 883	0,29
5,500 % éch. 04/04/2053	11 500	11 603	0,49
Total Pologne		33 286	1,41

QATAR**ÉMISSIONS SOUVERAINES**

Obligation internationale du gouvernement qatari			
4,400 % éch. 16/04/2050	21 100	19 239	0,81
4,500 % éch. 23/04/2028	7 000	7 014	0,30
4,817 % éch. 14/03/2049	12 465	12 005	0,51
5,103 % éch. 23/04/2048	1 000	999	0,04
Total Qatar		39 257	1,66

ROUMANIE**ÉMISSIONS SOUVERAINES**

Obligation internationale du gouvernement roumain			
1,750 % éch. 13/07/2030 (g)	€ 4 200	3 503	0,15
2,000 % éch. 08/12/2026	300	299	0,01
2,000 % éch. 14/04/2033	11 300	8 732	0,37
2,124 % éch. 16/07/2031 (g)	31 610	26 227	1,11
2,124 % éch. 16/07/2031	1 500	1 245	0,05
2,125 % éch. 07/03/2028	4 600	4 366	0,18
2,625 % éch. 02/12/2040	3 950	2 631	0,11
2,750 % éch. 14/04/2041	7 800	5 236	0,22
2,875 % éch. 13/04/2042	8 600	5 782	0,25
3,375 % éch. 28/01/2050	6 200	4 254	0,18
3,500 % éch. 03/04/2034	3 000	2 609	0,11
3,750 % éch. 07/02/2034	950	840	0,04
4,125 % éch. 11/03/2039	1 000	852	0,04
4,625 % éch. 03/04/2049	2 200	1 856	0,08
5,000 % éch. 27/09/2026	1 650	1 809	0,08
6,125 % éch. 22/01/2044	\$ 1 200	1 160	0,05
6,625 % éch. 27/09/2029	€ 1 900	2 158	0,09
7,625 % éch. 17/01/2053	\$ 8 600	9 474	0,40
Total Roumanie		83 033	3,52

RUSSIE**OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS**

MMK International Capital DAC			
4,375 % éch. 13/06/2024 ^	2 800	168	0,01

SÉNÉGAL**ÉMISSIONS SOUVERAINES**

Obligation internationale du gouvernement sénégalais			
4,750 % éch. 13/03/2028	€ 1 200	1 131	0,05
5,375 % éch. 08/06/2037	5 500	4 028	0,17
6,250 % éch. 23/05/2033	\$ 5 600	4 702	0,20
Total Sénégal		9 861	0,42

SERBIE**ÉMISSIONS SOUVERAINES**

Obligation internationale du gouvernement serbe			
1,000 % éch. 23/09/2028	€ 6 200	5 250	0,22
1,650 % éch. 03/03/2033	12 400	9 028	0,38
2,125 % éch. 01/12/2030	\$ 4 000	3 084	0,13
3,125 % éch. 15/05/2027	€ 7 300	7 165	0,30
6,500 % éch. 26/09/2033	\$ 9 500	9 340	0,40
Total Serbie		33 867	1,43

SINGAPOUR**OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS**

Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.			
4,250 % éch. 25/03/2027	5 208	4 577	0,19

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Flex Ltd.	\$ 200	\$ 191	0,01
United Overseas Bank Ltd.			
1,250 % éch. 14/04/2026	6 500	5 844	0,25
Total Singapour		10 612	0,45

AFRIQUE DU SUD**OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS**

Banque de développement de l'Afrique australe			
8,600 % éch. 21/10/2024 (f)	ZAR 253 300	13 178	0,56

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement sud-africain			
4,850 % éch. 30/09/2029	\$ 9 100	8 023	0,34
5,750 % éch. 30/09/2049	21 800	15 486	0,65
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 565 700	31 099	1,32
		54 608	2,31
Total Afrique du Sud		67 786	2,87

CORÉE DU SUD**OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS**

Hana Bank			
3,500 % éch.			
19/10/2026 (c)(d)	\$ 6 500	5 820	0,25
Hanwha Life Insurance Co. Ltd.			
3,379 % éch. 04/02/2032	6 700	6 004	0,25
Hyundai Capital Services, Inc.			
1,250 % éch. 08/02/2026	8 200	7 317	0,31
KB Kookmin Card Co. Ltd.			
1,500 % éch. 13/05/2026	10 000	8 858	0,37
4,000 % éch. 09/06/2025	7 900	7 594	0,32
Kodit Global Co. Ltd.			
4,954 % éch. 25/05/2026	1 200	1 182	0,05
Kookmin Bank			
2,500 % éch. 04/11/2030 (d)	2 500	2 031	0,09
Mirae Asset Securities Co. Ltd.			
1,375 % éch. 07/07/2024	17 600	16 674	0,71
NongHyup Bank			
1,250 % éch. 28/07/2026	13 000	11 418	0,48
Shinhan Bank Co. Ltd.			
4,375 % éch. 13/04/2032 (d)	9 000	8 208	0,35
Shinhan Card Co. Ltd.			
1,375 % éch. 19/10/2025	3 000	2 714	0,11
1,375 % éch. 23/06/2026	3 000	2 637	0,11
Shinhan Financial Group Co. Ltd.			
2,875 % éch.			
12/05/2026 (c)(d)	8 000	7 050	0,30
3,340 % éch. 05/02/2030 (d)	5 100	4 885	0,21
SK Hynix, Inc.			
2,375 % éch. 19/01/2031	5 300	4 091	0,17
Woori Card Co. Ltd.			
1,750 % éch. 23/03/2026	6 000	5 330	0,23
		101 813	4,31

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Export-Import Bank of Korea			
2,125 % éch. 18/01/2032	7 200	5 901	0,25
4,875 % éch. 11/01/2026	200	198	0,01
5,125 % éch. 11/01/2033	8 400	8 617	0,36
Korea Expressway Corp.			
1,125 % éch. 17/05/2026	4 800	4 253	0,18
Korea Water Resources Corp.			
3,500 % éch. 27/04/2025	6 500	6 267	0,27
		25 236	1,07
Total Corée du Sud		127 049	5,38

ESPAGNE**OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS**

Banco Santander S.A.			
5,147 % éch. 18/08/2025	9 600	9 434	0,40

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SRI LANKA			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka			
5,750 % éch. 18/04/2023 ^	\$ 6 900	\$ 3 147	0,13
5,875 % éch. 25/07/2022 ^	1 236	575	0,02
6,125 % éch. 03/06/2025 ^	3 700	1 765	0,08
6,200 % éch. 11/05/2027 ^	4 100	1 888	0,08
6,750 % éch. 18/04/2028 ^	6 800	3 131	0,13
6,825 % éch. 18/07/2026 ^	3 800	1 800	0,08
6,850 % éch. 14/03/2024 ^	900	414	0,02
6,850 % éch. 03/11/2025 ^	3 000	1 430	0,06
7,550 % éch. 28/03/2030 ^	16 800	7 735	0,33
7,850 % éch. 14/03/2029 ^	1 600	737	0,03
Total Sri Lanka		22 622	0,96

SUPRANATIONALES**OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS**

African Export-Import Bank			
2,634 % éch. 17/05/2026	5 500	4 977	0,21
Banque de développement asiatique			
4,700 % éch. 12/03/2024	MXN 89 800	4 951	0,21
6,550 % éch. 26/01/2025	ZAR 118 000	5 985	0,25
Banque Ouest Africaine de Développement			
2,750 % éch. 22/01/2033	€ 5 400	4 301	0,18
5,000 % éch. 27/07/2027	\$ 800	733	0,03
Banque de développement et de commerce d'Afrique orientale et australe			
4,125 % éch. 30/06/2028	6 900	5 448	0,23
Banque internationale pour la reconstruction et le développement			
5,310 % éch. 05/02/2026	ZAR 114 000	5 564	0,24
Société financière internationale			
8,000 % éch. 09/10/2023	IDR 57 500 000	3 852	0,16
		35 811	1,51

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement du Ghana			
10,750 % éch. 14/10/2030 ^	\$ 200	135	0,01
Total Supranationales		35 946	1,52

SUISSE**OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS**

Credit Suisse AG			
4,750 % éch. 09/08/2024	4 100	4 008	0,17
UBS Group AG			
4,490 % éch. 05/08/2025	4 200	4 107	0,17
6,373 % éch. 15/07/2026	3 200	3 181	0,14
Total Suisse		11 296	0,48

TANZANIE**CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS**

Ministère des Finances et de la Planification, Gouvernement de la République unie de Tanzanie			
9,048 % éch. 26/04/2028	€ 5 273	5 673	0,24

TUNISIE**ÉMISSIONS SOUVERAINES**

Obligation internationale du gouvernement de la Banque centrale de Tunisie			
5,625 % éch. 17/02/2024	4 300	3 902	0,17
5,750 % éch. 30/01/2025 (g)	\$ 1 400	937	0,04
6,375 % éch. 15/07/2026	€ 900	572	0,02
6,750 % éch. 31/10/2023	1 201	1 220	0,05
Total Tunisie		6 631	0,28

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
TURQUIE				ROYAUME-UNI				ÉTATS-UNIS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Akbank T.A.S. 6,800 % éch. 22/06/2031 (d)	\$ 6 500	\$ 5 942	0,25	Barclays PLC 5,304 % éch. 09/08/2026	\$ 6 000	\$ 5 855	0,25	JPMorgan Chase & Co. 0,653 % éch. 16/09/2024	\$ 2 600	\$ 2 570	0,11
Turkish Airlines Pass-Through Trust 4,200 % éch. 15/09/2028	200	184	0,01	5,746 % éch. 09/08/2033	1 000	968	0,04	Morgan Stanley 0,864 % éch. 21/10/2025	2 500	2 326	0,10
		6 126	0,26	HSBC Holdings PLC 3,803 % éch. 11/03/2025	300	294	0,01	Pricoa Global Funding 4,200 % éch. 28/08/2025	450	436	0,02
ÉMISSIONS SOUVERAINES				TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Export-Credit Bank of Turkey 5,750 % éch. 06/07/2026	11 000	9 965	0,42	Lloyds Banking Group PLC 4,716 % éch. 11/08/2028	2 500	2 447	0,10	Rutas 2 and 7 Finance Ltd. 0,000 % éch. 30/09/2036 (b)	4 680	3 069	0,13
8,250 % éch. 24/01/2024	900	899	0,04	NatWest Group PLC 4,269 % éch. 22/03/2025	200	197	0,01	Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % éch. 09/09/2026	12 000	11 792	0,50
Obligation internationale du gouvernement turc 4,875 % éch. 16/04/2043	8 200	5 284	0,22	5,076 % éch. 27/01/2030	300	286	0,01			40 402	1,71
5,125 % éch. 17/02/2028	2 500	2 180	0,09	Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC 7,875 % éch. 15/07/2028 ^	6 500	2 490	0,11	AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
5,750 % éch. 11/05/2047	23 700	16 254	0,69	8,250 % éch. 09/07/2026 ^	3 100	1 194	0,05	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
5,875 % éch. 26/06/2031	2 400	2 006	0,09	Ukreximbank Via Biz Finance PLC 9,750 % éch. 22/01/2025	650	569	0,02	2,500 % éch. 01/07/2053			
5,950 % éch. 15/01/2031	900	761	0,03			16 827	0,71	3,500 % éch. 01/08/2053			
6,000 % éch. 14/01/2041	0	0	0,00	ÉTATS-UNIS				OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
6,875 % éch. 17/03/2036	0	0	0,00	TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				Obligations du Trésor américain			
9,125 % éch. 13/07/2030	5 300	5 267	0,22	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,630 % éch. 25/02/2037	\$ 700	673	0,03	2,375 % éch. 15/02/2042 (g)			
		42 616	1,80	6,275 % éch. 25/11/2035	639	622	0,03	3,250 % éch. 15/05/2042			
Total Turquie		48 742	2,06	Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust 3,156 % éch. 25/01/2037 ^	2 325	728	0,03	3,375 % éch. 15/08/2042			
UKRAINE				ÉTATS-UNIS				Billets du Trésor américain			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				3,125 % éch. 31/08/2029			
NPC Ukrenrgo 6,875 % éch. 09/11/2028 ^	8 100	1 741	0,08	Long Beach Mortgage Loan Trust 5,450 % éch. 25/09/2036	801	510	0,02	Total États-Unis			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				URUGUAY			
State Agency of Roads of Ukraine 6,250 % éch. 24/06/2030 ^	\$ 7 900	1 722	0,07	MASTR Asset-Backed Securities Trust 5,590 % éch. 25/11/2036	888	529	0,02	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement ukrainien 4,375 % éch. 27/01/2032 ^	€ 2 700	644	0,03	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,945 % éch. 25/03/2034	739	713	0,03	Obligation internationale du gouvernement uruguayen			
6,876 % éch. 21/05/2031 ^	\$ 8 300	1 916	0,08	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 5,300 % éch. 25/07/2036	172	155	0,01	4,975 % éch. 20/04/2055			
7,253 % éch. 15/03/2035 ^	23 400	5 453	0,23	Option One Mortgage Loan Trust 5,370 % éch. 25/05/2037	230	136	0,01	5,100 % éch. 18/06/2050			
7,375 % éch. 25/09/2034 ^	5 900	1 385	0,06	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,930 % éch. 25/09/2035	1 000	841	0,04	5,750 % éch. 28/10/2034			
7,750 % éch. 01/09/2024 ^	3 900	979	0,04	Saxon Asset Securities Trust 5,460 % éch. 25/09/2037	44	41	0,00	7,625 % éch. 21/03/2036			
7,750 % éch. 01/09/2025 ^	6 800	1 736	0,07	Soundview Home Loan Trust 5,330 % éch. 25/02/2037	194	56	0,00	7,875 % éch. 15/01/2033			
7,750 % éch. 01/09/2026 ^	12 300	2 996	0,13	5,605 % éch. 25/10/2037	124	97	0,00	Total Uruguay			
7,750 % éch. 01/09/2027 ^	9 000	2 172	0,09			5 101	0,22	40 766			
7,750 % éch. 01/09/2028 ^	100	24	0,00	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				VIETNAM			
8,994 % éch. 01/02/2026 ^	4 300	1 088	0,05	Alphabet, Inc. 2,250 % éch. 15/08/2060	\$ 4 100	2 497	0,10	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
		20 115	0,85	Bank of America Corp. 0,981 % éch. 25/09/2025	8 700	8 177	0,35	Obligation internationale du gouvernement vietnamien			
Total Ukraine		21 856	0,93	Credit Suisse AG AT1 Claim ^	2 100	84	0,00	4,800 % éch. 19/11/2024			
ÉMIRATS ARABES UNIS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Obligation internationale du gouvernement vietnamien			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Obligation internationale du gouvernement vietnamien							
First Abu Dhabi Bank PJSC 4,774 % éch. 06/06/2028	6 500	6 447	0,27	Ford Motor Co. 3,250 % éch. 12/02/2032	12 000	9 451	0,40	1 000			
MDGH GMTN RSC Ltd. 3,700 % éch. 07/11/2049	3 000	2 392	0,10					984			
3,950 % éch. 21/05/2050	800	667	0,03					0,04			
5,084 % éch. 22/05/2053	2 000	1 993	0,09								
Sweihan PV Power Co. PJSC 3,625 % éch. 31/01/2049	4 965	4 019	0,17								
		15 518	0,66								
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS							
NMC OpCo Ltd. 11,255 % éch. 25/03/2027	AED 25 528	7 019	0,30								
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi							
Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi 3,125 % éch. 30/09/2049	\$ 800	588	0,02								
3,875 % éch. 16/04/2050	4 600	3 879	0,16								
Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat de Dubaï 3,900 % éch. 09/09/2050	700	508	0,02								
Département des finances du gouvernement de Sharjah 4,000 % éch. 28/07/2050	4 800	3 084	0,13								
4,375 % éch. 10/03/2051	3 000	2 061	0,09								
6,500 % éch. 23/11/2032	12 300	12 719	0,54								
		22 839	0,96								
Total Émirats arabes unis		45 376	1,92								

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets 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	CDI BRL à 1 an	13,400%	02/01/2025	BRL 93 200	\$ 568	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	15/09/2023	\$ 1 800	(25)	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,950	30/11/2024	ZAR 346 600	677	0,03
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,611	06/06/2028	CZK 639 600	(157)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	€ 12 500	(111)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,455	10/01/2028	PLN 18 000	(37)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,490	10/01/2028	PLN 17 100	(41)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,585	18/05/2028	MXN 34 400	(17)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	8,740	07/03/2028	MXN 110 800	75	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,760	19/05/2028	MXN 1 600	(1)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,900	21/05/2027	MXN 120 600	(67)	0,00
					\$ 1 586	0,07
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 1 587	0,07

(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.

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	3,380 %	31/07/2023	4 100	\$ (16)	\$ (19)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	4 100	(16)	(12)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	2 600	(8)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	2 600	(8)	(13)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	1 900	(4)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	1 900	(4)	(7)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	2 100	(7)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	2 100	(7)	(10)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	1 900	(5)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	1 900	(5)	(7)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	3 600	(12)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	3 600	(12)	(15)	0,00
							\$ (104)	\$ (106)	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 omanais	(1,000) %	20/12/2027	\$ 2 200	\$ 72	\$ (42)	\$ 30	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	4 300	715	(260)	455	0,02
BPS	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000)	20/12/2027	700	23	(13)	10	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000)	20/12/2027	3 400	91	(45)	46	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2024	15 000	(167)	51	(116)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	2 800	467	(170)	297	0,01
GST	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2024	15 000	(167)	51	(116)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2028	43 200	(1 141)	(170)	(1 311)	(0,06)
MYC	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	2 500	423	(158)	265	0,01
					\$ 316	\$ (756)	\$ (440)	(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
BOA	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000 %	20/06/2031	\$ 1 200	\$ (181)	\$ 63	\$ (118)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2024	200	1	1	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	18 100	13	179	192	0,01
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	6 400	26	86	112	0,01
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/12/2031	11 900	(502)	267	(235)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	9 400	(90)	91	1	0,00

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel ⁽¹⁾	Primes payées/(reçues)	Plus-value/(moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net	
BPS	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000 %	20/12/2025	\$ 1 200	\$ (66)	\$ 46	\$ (20)	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	100	(20)	8	(12)	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2026	10 400	(639)	605	(34)	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2027	8 200	(589)	409	(180)	(0,01)	
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2023	900	2	2	4	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2024	3 300	9	20	29	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2024	4 000	5	44	49	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	4 200	(2)	15	13	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	500	0	2	2	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	2 100	(5)	27	22	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	6 100	54	53	107	0,01	
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	700	2	1	3	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	1 400	(6)	10	4	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement serbe	1,000	20/12/2027	1 600	(142)	70	(72)	0,00	
	BRC	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2028	32 000	(2 760)	522	(2 238)	(0,09)
Obligation internationale du gouvernement turc		1,000	20/06/2027	3 800	(751)	292	(459)	(0,02)	
Obligation internationale du gouvernement argentin		5,000	20/12/2023	800	(96)	37	(59)	0,00	
Obligation internationale du gouvernement brésilien		1,000	20/12/2030	1 400	(194)	68	(126)	(0,01)	
Obligation internationale du gouvernement chilien		1,000	20/06/2024	5 800	18	33	51	0,00	
Obligation internationale du gouvernement chilien		1,000	20/12/2026	2 500	14	31	45	0,00	
Obligation internationale du gouvernement hongrois		1,000	20/12/2023	4 000	(29)	40	11	0,00	
Obligation internationale du gouvernement péruvien		1,000	20/12/2025	17 500	360	(77)	283	0,01	
Obligation internationale du gouvernement polonais		1,000	20/06/2028	6 500	49	24	73	0,00	
Obligation internationale du gouvernement roumain		1,000	20/12/2023	800	(6)	9	3	0,00	
CBK	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	4 200	(1)	14	13	0,00	
	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	(1)	2	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement panaméen	1,000	20/06/2024	2 300	4	12	16	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement panaméen	1,000	20/12/2024	4 300	0	39	39	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	2 100	18	19	37	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement qatari	1,000	20/12/2026	5 000	140	(17)	123	0,01	
DUB	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	13 800	(148)	150	2	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	10 400	(638)	271	(367)	(0,01)	
GLM	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	600	(2)	4	2	0,00	
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2026	200	(11)	12	1	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2031	1 500	(227)	80	(147)	(0,01)	
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2028	9 500	18	101	119	0,01	
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2024	14 000	(34)	74	40	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/06/2028	10 100	37	29	66	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	900	1	3	4	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	13 700	98	141	239	0,01	
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	1 500	5	1	6	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/06/2024	11 200	50	33	83	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/06/2028	8 500	77	19	96	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	1 000	(10)	10	0	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	4 300	(840)	321	(519)	(0,02)	
	HUS	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	100	(1)	2	1	0,00
	JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20/12/2024	8 000	(179)	114	(65)	0,00
Obligation internationale du gouvernement hongrois		1,000	20/06/2027	5 700	(290)	212	(78)	0,00	
MYC	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/12/2024	7 400	60	16	76	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/06/2028	900	(2)	12	10	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	2 500	(40)	44	4	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement argentin	5,000	20/12/2023	1 500	(289)	178	(111)	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2027	2 800	(173)	143	(30)	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2030	2 900	(405)	144	(261)	(0,01)	
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2024	2 400	6	24	30	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2026	15 000	208	64	272	0,01	
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	16 300	112	179	291	0,01	
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	3 800	0	12	12	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	4 800	19	32	51	0,00	
MYI	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2028	200	(5)	5	0	0,00	
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	9 800	45	127	172	0,01	
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/12/2026	20 000	80	261	341	0,02	
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	4 600	(206)	43	(163)	(0,01)	
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	1 800	(356)	139	(217)	(0,01)	
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	1 300	11	12	23	0,00	
					\$ (8 393)	\$ 6 060	\$ (2 333)	(0,10)	

(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.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG 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	
BOA	07/2023	€	905	\$ 989	\$ 2	\$ 2	0,00	
	07/2023	ILS	34 300	9 926	677	677	0,03	
	07/2023	¥	700	5	0	0	0,00	
	07/2023	PLN	393	94	0	(3)	0,00	
	07/2023	\$	7 163	€ 6 665	109	0	109	0,00
BPS	07/2023		2 337	£ 1 848	12	0	12	0,00
	07/2023		29	PLN 122	1	0	1	0,00
	07/2023	€	336	\$ 366	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	228 990	€ 208 990	0	(982)	(982)	(0,04)
	07/2023		11 951	¥ 1 661 103	0	(458)	(458)	(0,02)
	07/2023		18	MYR 84	0	0	0	0,00
	08/2023	€	208 990	\$ 229 312	992	0	992	0,04
	08/2023	MYR	75 495	\$ 16 251	28	0	28	0,00
	08/2023	\$	8	CNY 53	0	0	0	0,00
	08/2023	ZAR	189 371	\$ 10 176	192	0	192	0,01
BRC	09/2023	\$	3 045	INR 250 285	0	(2)	(2)	0,00
	11/2023	ILS	25 816	\$ 7 485	482	0	482	0,02
	07/2023	\$	15	MYR 70	0	0	0	0,00
	08/2023	COP	38 490 507	\$ 9 035	0	(69)	(69)	0,00
	08/2023	ZAR	350 461	\$ 18 705	317	(86)	231	0,01
	09/2023	\$	61	ILS 218	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	ZAR	253 669	\$ 14 363	1 028	0	1 028	0,04
	10/2023	MXN	202 568	\$ 10 811	0	(772)	(772)	(0,03)
	07/2023	CZK	5 142	\$ 234	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	€	15 747	\$ 16 966	1	(215)	(214)	(0,01)
CBK	07/2023	ILS	183 353	\$ 56 947	7 535	0	7 535	0,32
	07/2023	\$	1 348	€ 1 232	0	(4)	(4)	0,00
	08/2023	COP	19 735 373	\$ 4 667	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	ILS	133 218	\$ 41 282	5 358	0	5 358	0,23
	11/2023		116 445	\$ 34 322	2 735	0	2 735	0,12
	11/2023	\$	1 610	EGP 51 961	0	(111)	(111)	(0,01)
	07/2023	ILS	24 133	\$ 6 892	385	0	385	0,02
	10/2023	ZAR	152 660	\$ 8 383	386	0	386	0,02
	11/2023	EGP	146 354	\$ 5 151	930	0	930	0,04
	07/2023	BRL	68 480	\$ 14 182	0	(13)	(13)	0,00
GLM	07/2023	DOP	659 238	\$ 11 385	0	(415)	(415)	(0,02)
	07/2023	\$	12 767	BRL 68 263	1 383	0	1 383	0,06
	07/2023		72	PLN 304	3	0	3	0,00
	08/2023	DOP	372 278	\$ 6 612	26	(77)	(51)	0,00
	09/2023	\$	14 182	BRL 69 239	11	0	11	0,00
	10/2023	DOP	216 683	\$ 3 865	24	0	24	0,00
	11/2023		158 353	\$ 2 848	62	0	62	0,00
	11/2023	EGP	25 380	\$ 900	168	0	168	0,01
	11/2023	\$	5 231	EGP 158 950	0	(646)	(646)	(0,03)
	12/2023	DOP	128 789	\$ 2 313	54	0	54	0,00
JPM	07/2023	£	122	\$ 154	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	¥	565 444	\$ 3 954	42	0	42	0,00
	08/2023	COP	11 592 523	\$ 2 734	0	(19)	(19)	0,00
	08/2023	MXN	222 130	\$ 12 821	0	(27)	(27)	0,00
	08/2023	\$	8	CNY 56	0	0	0	0,00
	08/2023		154	£ 122	1	0	1	0,00
	08/2023		3 954	¥ 563 041	0	(42)	(42)	0,00
	09/2023	COP	7 349 683	\$ 1 728	4	0	4	0,00
	09/2023	PEN	1 851	\$ 503	0	(5)	(5)	0,00
	09/2023	\$	59	ILS 209	0	(2)	(2)	0,00
MBC	10/2023	MXN	94 231	\$ 5 367	0	(22)	(22)	0,00
	07/2023	€	1 618	\$ 1 735	0	(30)	(30)	0,00
	07/2023	£	18 528	\$ 22 935	0	(621)	(621)	(0,03)
	07/2023	\$	38 868	ILS 141 185	0	(808)	(808)	(0,03)
	08/2023		234	ZAR 4 333	0	(5)	(5)	0,00
	09/2023		8 698	INR 715 169	0	(5)	(5)	0,00
	11/2023		41 667	ILS 150 231	0	(916)	(916)	(0,04)
	07/2023	€	7 215	\$ 7 857	0	(15)	(15)	0,00
	07/2023	£	20	\$ 25	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	114	CZK 2 521	1	0	1	0,00
MYI	07/2023		239	€ 219	0	0	0	0,00
	07/2023		1 860	£ 1 474	14	0	14	0,00
	08/2023		1 621	ZAR 29 663	0	(57)	(57)	0,00
	09/2023	AED	26 160	\$ 7 122	0	0	0	0,00
	11/2023	EGP	40 209	\$ 1 425	265	0	265	0,01
	07/2023	\$	20	MXN 394	2	0	2	0,00
	08/2023		12 997	\$ 225 246	30	0	30	0,00
	07/2023		74	£ 59	1	0	1	0,00
	07/2023		19	MYR 85	0	0	0	0,00
	08/2023	CNH	349	\$ 51	3	0	3	0,00
SOG	08/2023	\$	50	CNH 343	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023		36 697	ILS 133 218	0	(772)	(772)	(0,03)
	07/2023	€	195 421	\$ 210 222	0	(2 982)	(2 982)	(0,13)
	07/2023	PLN	1 598	\$ 371	0	(22)	(22)	0,00
SSB	09/2023	BRL	61 602	\$ 12 151	0	(477)	(477)	(0,02)
	TOR	\$	21 195	£ 16 680	11	0	11	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
	08/2023	£ 16 680	\$ 21 200	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
UAG	07/2023	€ 2 860	\$ 3 060	0	(60)	(60)	0,00
	07/2023	\$ 28 664	ILS 100 600	0	(1 555)	(1 555)	(0,07)
	08/2023	ZAR 1 355	\$ 71	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	\$ 51	ILS 181	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	ZAR 83 188	\$ 4 745	372	0	372	0,01
	10/2023		2 657	80	0	80	0,00
	11/2023	ILS 7 970	2 305	143	0	143	0,01
				\$ 23 870	\$ (12 317)	\$ 11 553	0,49

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$ 406	CHF 363	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07/2023	CHF 17 412	\$ 19 469	7	0	7	0,00
	07/2023	\$ 27 869	CHF 25 218	319	0	319	0,01
	08/2023	19 469	17 362	0	(7)	(7)	0,00
MBC	07/2023	CHF 2	\$ 2	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	487	538	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07/2023	\$ 32 107	CHF 28 961	264	0	264	0,01
				\$ 590	\$ (13)	\$ 577	0,02

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 1 058	\$ 1 149	\$ 1	\$ (6)	\$ (5)	0,00
	07/2023	\$ 396 548	€ 368 983	6 014	0	6 014	0,25
BPS	07/2023	€ 382 136	\$ 418 682	1 774	(2)	1 772	0,08
	07/2023	\$ 396 560	€ 368 873	5 887	(7)	5 880	0,25
	08/2023	412 433	375 883	0	(1 785)	(1 785)	(0,08)
CBK	07/2023	€ 370 707	\$ 402 816	1	(1 627)	(1 626)	(0,07)
	07/2023	\$ 11 375	€ 10 549	135	(1)	134	0,01
	08/2023	385 865	354 416	1 333	0	1 333	0,06
JPM	07/2023	€ 375 492	\$ 410 000	338	0	338	0,01
	07/2023	\$ 25 373	€ 23 731	518	0	518	0,02
	08/2023	410 573	375 492	0	(350)	(350)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 38 829	\$ 41 694	6	(674)	(668)	(0,03)
	07/2023	\$ 29 612	€ 27 391	271	0	271	0,01
SOG	07/2023	396 021	368 139	5 618	0	5 618	0,24
				\$ 21 896	\$ (4 452)	\$ 17 444	0,74

Au 30 juin 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	07/2023	£ 13	\$ 17	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 263	£ 208	2	0	2	0,00
BPS	07/2023	46 039	37 219	1 281	(1)	1 280	0,06
BRC	07/2023	£ 27	\$ 34	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 104	£ 82	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	£ 940	\$ 1 191	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	\$ 458	£ 362	2	0	2	0,00
MBC	07/2023	45 908	37 082	1 237	0	1 237	0,05
MYI	07/2023	£ 18	\$ 23	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 45 592	£ 36 683	1 045	0	1 045	0,04
				\$ 3 567	\$ (6)	\$ 3 561	0,15

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 183	NOK 2 022	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
BPS	07/2023	NOK 1 399	\$ 130	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 130	NOK 1 397	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	NOK 75	\$ 7	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 157	NOK 1 762	8	0	8	0,00
GLM	07/2023	NOK 1 479	\$ 137	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$ 137	NOK 1 478	1	0	1	0,00
UAG	07/2023	140	1 548	5	0	5	0,00
				\$ 19	\$ (1)	\$ 18	0,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)

Au 30 juin 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	07/2023	SEK	8 925	\$ 827	\$ 1	\$ 0	0,00		
	07/2023	\$	8	SEK 84	0	0	0,00		
	08/2023		789	8 509	0	(1)	0,00		
BRC	07/2023		45	483	0	0	0,00		
CBK	07/2023		566	6 178	6	0	0,00		
GLM	07/2023	SEK	1 245	\$ 115	0	0	0,00		
MBC	07/2023	\$	6	SEK 69	0	0	0,00		
	07/2023	SEK	13	\$ 1	0	0	0,00		
MYI	07/2023	\$	530	SEK 5 712	0	(2)	0,00		
	07/2023	SEK	8 523	\$ 789	0	0	0,00		
	07/2023	\$	810	SEK 8 699	0	(5)	0,00		
SCX	08/2023		789	8 512	0	0	0,00		
	07/2023	SEK	205	\$ 19	0	0	0,00		
	07/2023	\$	529	SEK 5 723	1	0	0,00		
						\$ 8	\$ (8)	\$ 0	0,00
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$	30 274	1,28	

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 2,500 % éch. 01/07/2053 (e)	\$ 650	\$ (551)	(0,02)
Total des Titres vendus à découvert	\$	(551)	(0,02)

CERTIFICATS DE DÉPÔT

Banco Davivienda S.A. 13,501 % éch. 13/12/2024	COP	10 517 000	2 518	0,11
15,389 % éch. 21/02/2024		3 593 000	873	0,04
Bancolombia S.A. 5,917 % éch. 27/01/2024		16 789 000	3 870	0,16
13,320 % éch. 08/06/2025		5 439 000	1 307	0,06
13,637 % éch. 14/12/2024		14 365 000	3 460	0,15
16,137 % éch. 01/09/2024		5 832 000	1 413	0,06
BBVA Colombia S.A. 5,870 % éch. 15/07/2024		12 069 000	2 715	0,11
14,540 % éch. 13/01/2024		7 110 900	1 689	0,07
16,412 % éch. 25/04/2024		258 000	60	0,00
Total des Certificats de dépôt		\$	17 905	0,76
Total des Investissements		\$	2 378 897	100,70
Autres actifs et passifs à court terme		\$	(16 564)	(0,70)
Actifs nets		\$	2 362 333	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) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(d) Titre convertible conditionnel.

(e) Un titre vendu à découvert au 30 juin 2023 est couvert par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(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 de l'Afrique australe	8,600 %	21/10/2024	07/10/2021	\$ 17 010	\$ 13 178	0,56

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 37 109 \$ (31 décembre 2022 : 38 910 \$) et un montant en numéraire de 264 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 280 \$ (31 décembre 2022 : 807 \$) 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 15 395 \$ (31 décembre 2022 : 18 655 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 4 530 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 2 215 125	\$ 27 259	\$ 2 242 384
Contrats de mise en pension	0	90 940	0	90 940
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	6 492	11 413	17 905
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	932	27 287	0	28 219
Titres vendus à découvert	0	(551)	0	(551)
Totaux	\$ 932	\$ 2 339 293	\$ 38 672	\$ 2 378 897

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	\$ 2 396 551	\$ 25 705	\$ 2 422 256
Contrats de mise en pension	0	44 661	0	44 661
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	1 659	1 659
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	5 273	27 624	(11)	32 886
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 30 juin 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	5,190 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ (701)	\$ (701)	(0,03)
BPS	3,650	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (19 808)	(21 717)	(0,92)
BRC	4,800	05/05/2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (789)	(793)	(0,03)
MYI	3,900	05/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(3 511)	(3 534)	(0,15)
	4,250	05/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(1 518)	(1 528)	(0,06)
NOM	3,250	05/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(2 171)	(2 188)	(0,09)
	5,050	05/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(4 872)	(4 911)	(0,21)
SCX	3,580	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (1 449)	(1 589)	(0,07)
Total des Contrats de prise en pension					\$ (36 961)	(1,56)

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 7 190	\$ (5 690)	\$ 1 500	\$ 5	\$ 0	\$ 5
BPS	4 978	(3 290)	1 688	(1 369)	2 060	691
BRC	714	(420)	294	(218)	320	102
CBK	15 561	(14 983)	578	22 572	(21 703)	869
DUB	1 336	(990)	346	(250)	270	20
FBF	S/O	S/O	S/O	(5)	0	(5)
GLM	557	(440)	117	619	(580)	39
GST	(1 439)	1 460	21	(2 119)	2 110	(9)
HUS	1	0	1	1	0	1
JPM	382	(360)	22	(645)	680	35
MBC	(1 547)	1 240	(307)	5 068	(4 320)	748
MYC	631	(540)	91	(538)	760	222
MYI	1 264	(500)	764	23	0	23
RBC	32	0	32	(189)	0	(189)
SCX	(506)	420	(86)	9 690	(9 190)	500
SOG	2 614	(1 930)	684	(20)	0	(20)
SSB	(477)	620	143	S/O	S/O	S/O
TOR	1	0	1	S/O	S/O	S/O
UAG	(1 018)	790	(228)	(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.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	85,19	84,95
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	9,73	12,05
Autres valeurs mobilières	0,00	0,17
Contrats de mise en pension	3,85	1,79
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,16)	0,04
Instruments financiers dérivés compensés	0,07	(0,02)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,28	1,30
Titres vendus à découvert	(0,02)	S/O
Certificats de dépôt	0,76	0,07
Contrats de prise en pension	(1,56)	(1,56)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Argentine	2,30	1,90
Arménie	0,28	0,27
Bahamas	0,36	0,33
Bahreïn	0,97	0,93
Bénin	0,44	0,36
Bermudes	0,15	0,13
Brésil	1,77	3,00
Bulgarie	0,25	S/O
Îles Caïmans	1,89	2,06
Chili	2,26	2,80
Chine	0,00	0,01
Colombie	2,71	2,57
Costa Rica	0,86	1,12
Chypre	0,27	0,24
République dominicaine	4,41	2,95
Équateur	1,59	2,19
Égypte	1,75	2,28
Salvador	0,73	0,48
France	S/O	0,10
Gabon	0,06	S/O
Géorgie	0,39	0,39
Allemagne	S/O	0,02
Ghana	1,32	1,16
Guernesey, Îles Anglo-normandes	0,12	0,12
Hong Kong	1,96	1,28
Hongrie	3,39	2,09
Inde	1,38	1,69
Indonésie	2,86	2,63
Internationales	0,22	S/O
Irlande	0,08	0,08
Israël	S/O	2,24
Côte d'Ivoire	0,95	1,27
Jamaïque	0,16	0,17
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,52	0,48
Jordanie	0,66	0,38
Kazakhstan	1,19	1,46
Kenya	0,58	0,54
Luxembourg	0,28	0,36
Macédoine du nord	0,74	S/O
Malaisie	1,23	0,13
Île Maurice	0,40	0,85
Mexique	2,98	2,31
Mongolie	0,31	0,65
Maroc	0,65	0,77
Multinationales	0,02	0,02
Namibie	0,09	0,09
Pays-Bas	1,36	0,87
Oman	2,89	3,07
Panama	3,26	2,85
Paraguay	1,03	0,91
Pérou	1,42	1,36
Philippines	1,45	1,24
Pologne	1,41	0,40
Qatar	1,66	1,81
Roumanie	3,52	2,26
Russie	0,01	0,04
Sénégal	0,42	0,41
Serbie	1,43	0,84
Singapour	0,45	0,43
Afrique du Sud	2,87	3,59
Corée du Sud	5,38	4,60
Espagne	0,40	0,38
Sri Lanka	0,96	0,67
Supranationales	1,52	1,81
Suisse	0,48	0,58

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Tanzanie	0,24	0,24
Tunisie	0,28	0,34
Turquie	2,06	2,08
Ukraine	0,93	0,78
Émirats arabes unis	1,92	1,00
Royaume-Uni	1,48	1,65
États-Unis	7,78	7,06
Uruguay	1,73	1,65
Ouzbékistan	S/O	0,03
Vietnam	0,04	0,04
Îles Vierges britanniques	0,26	0,73
Zambie	0,14	0,12
Instruments à court terme	0,61	8,43
Contrats de mise en pension	3,85	1,79
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,16)	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	0,07	(0,02)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt		0,00
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	(0,10)	(0,18)
Swaps de volatilité	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,49	0,21
Contrats de change à terme couverts	0,91	1,27
Titres vendus à découvert	(0,02)	S/O
Certificats de dépôt	0,76	0,07
Autres actifs et passifs à court terme	(0,70)	(0,35)
Actifs nets	100,00	100,00

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.EM-39 à 5 ans	1,000 %	20/06/2028	\$ 3 800	\$ 10	0,01
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	5,000	20/06/2028	400	11	0,01
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	2 400	17	0,01
Indice iTraxx Asia Ex-Japan 39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	3 500	39	0,02
Indice iTraxx Crossover 39 à 5 ans	5,000	20/06/2028	€ 1 100	30	0,02
Indice iTraxx Europe Main 39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	1 900	20	0,01
				\$ 127	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 recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000 %	21/09/2024	\$ 12 500	\$ 429	0,27
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	21/06/2047	1 700	182	0,11
À payer	CDI BRL à 1 an	12,090	04/01/2027	BRL 6 500	8	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,665	15/03/2028	KRW 999 100	(3)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	21/09/2023	\$ 1 700	17	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,205	22/04/2027	ZAR 7 200	17	0,01
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,210	22/04/2027	35 600	(27)	(0,02)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,611	06/06/2028	CZK 17 200	(5)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,930	29/06/2028	PLN 1 700	(1)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,207	19/06/2028	MXN 6 900	(3)	0,00
					\$ 614	0,38
					\$ 736	0,46

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.

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. Obligation internationale du gouvernement turc	1,000 %	20/12/2025	\$ 1 200	\$ (30)	\$ 42	\$ 12	0,01
CBK	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2028	500	(87)	12	(75)	(0,05)
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2026	50	0	1	1	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2026	900	(42)	10	(32)	(0,02)
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20/06/2024	300	1	1	2	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	400	(9)	6	(3)	0,00
		1,000	20/06/2028	400	(9)	8	(1)	0,00
					\$ (176)	\$ 80	\$ (96)	(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
BOA	07/2023	€ 31	\$ 34	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	PLN 2 207	\$ 542	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$ 198	CNY 1 361	0	(10)	(10)	(0,01)
	09/2023	PHP 17 450	\$ 315	0	0	0	0,00
	09/2023	\$ 105	HKD 822	0	0	0	0,00
	11/2023	519	ILS 1 865	0	(13)	(13)	(0,01)

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			
BPS	07/2023	CZK	\$	34	\$	0	0,00			
	07/2023	\$	€	5 835		(27)	(0,02)			
	08/2023	CNH	\$	898		44	0,03			
	08/2023	€	\$	6 403		28	0,02			
	08/2023	\$	CNY	1 601		(13)	(0,01)			
	08/2023		ZAR	475		0	0,00			
	08/2023	ZAR	\$	36		1	0,00			
	10/2023			407		10	0,01			
	11/2023	ILS		1 152		70	0,04			
BRC	08/2023	COP	\$	429		(3)	0,00			
	08/2023	\$	ZAR	575		(1)	0,00			
BSH	08/2023		BRL	2 456		3	0,00			
CBK	07/2023	€	\$	101		(2)	0,00			
	07/2023	ILS		1 570		166	0,10			
	07/2023	\$	€	85		0	0,00			
	07/2023		£	552		4	0,00			
	08/2023	COP	\$	317		0	0,00			
	09/2023			68		1	0,00			
DUB	07/2023	BRL		277		(34)	(0,02)			
	10/2023	ZAR		357		16	0,01			
GLM	07/2023	DOP		430		(16)	(0,01)			
	07/2023	\$	BRL	1 504		0	0,00			
	09/2023	BRL	\$	312		0	0,00			
	09/2023	\$	THB	15 007		1	0,00			
	10/2023	ZAR	\$	112		3	0,00			
JPM	08/2023	CNH		424		20	0,01			
	08/2023	COP		186		(1)	0,00			
	08/2023	\$	CNY	1 689		(13)	(0,01)			
	08/2023	ZAR	\$	25		(1)	0,00			
	09/2023	COP		87		0	0,00			
	09/2023	\$	ILS	13		0	0,00			
	09/2023		MXN	6 245		(1)	0,00			
MBC	07/2023	£	\$	1 363		(37)	(0,02)			
	09/2023	\$	IDR	4 964 613		(1)	0,00			
	09/2023		INR	41 455		0	0,00			
MYI	07/2023		€	4		0	0,00			
	07/2023		ILS	5 226		(42)	(0,03)			
	07/2023		MYR	1 394		0	0,00			
	09/2023	PEN	\$	227		(1)	0,00			
	09/2023	\$	PEN	1 208		0	0,00			
	11/2023		ILS	4 047		(48)	(0,03)			
RBC	07/2023	¥	\$	3 294		311	0,19			
SCX	08/2023	CNH		202		10	0,01			
	08/2023	\$	CNY	4 484		(36)	(0,02)			
SOG	07/2023	€	\$	6 234		(88)	(0,05)			
TOR	07/2023	\$	£	1 101		1	0,00			
	08/2023	£	\$	1 399		(1)	0,00			
UAG	08/2023	ZAR		393		(5)	0,00			
	09/2023	\$	ZAR	1 685		(8)	0,00			
	11/2023	ILS	\$	576		36	0,02			
				\$	725	\$	(403)	\$	322	0,20

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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			
BPS	07/2023	CHF	\$	3 382	\$	1	0,00			
	07/2023	\$	CHF	4 088		51	0,03			
	08/2023			3 016		(1)	0,00			
JPM	07/2023	CHF	\$	22		0	0,00			
MBC	07/2023			7		0	0,00			
MYI	07/2023			160		(2)	0,00			
SCX	07/2023	\$	CHF	2 921		14	0,01			
UAG	07/2023	CHF	\$	3 484		(7)	0,00			
	07/2023	\$	CHF	2 632		13	0,01			
	08/2023			3 114		7	0,00			
				\$	86	\$	(10)	\$	76	0,05

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€	\$	13	\$	0	0,00
	07/2023	\$	€	38 150		622	0,39
BPS	07/2023	€	\$	38 555		181	0,11

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	07/2023	\$	40 945	€ 38 088	\$ 609	\$ 609	0,38
	08/2023		42 098	€ 38 367	0	(182)	(0,11)
CBK	07/2023	€	39 264	\$ 42 667	0	(170)	(0,11)
	08/2023	\$	40 863	€ 37 532	141	141	0,09
JPM	07/2023	€	38 338	\$ 41 861	34	34	0,02
	07/2023	\$	1 995	€ 1 866	41	41	0,03
	08/2023		41 920	€ 38 338	0	(36)	(0,02)
MBC	07/2023	€	30	\$ 32	0	0	0,00
	07/2023	\$	5	€ 5	0	0	0,00
SOG	07/2023		40 973	€ 38 088	581	581	0,36
					\$ 2 209	\$ (389)	1,14

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 2 122 1,33

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CERTIFICATS DE DÉPÔT			
Banco Davivienda S.A. 13,501 % éch. 13/12/2024		COP 714 000 \$ 171	0,11
Bancolombia S.A. 5,917 % éch. 27/01/2024	1 097 400	253	0,16
13,320 % éch. 08/06/2025	369 000	89	0,05
13,637 % éch. 14/12/2024	978 000	235	0,15
16,137 % éch. 01/09/2024	400 000	97	0,06
BBVA Colombia S.A. 5,870 % éch. 15/07/2024	816 000	184	0,11
14,540 % éch. 13/01/2024	467 400	111	0,07
Total des Certificats de dépôt		\$ 1 140	0,71
Total des Investissements		\$ 161 716	101,24
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (1 983)	(1,24)
Actifs nets		\$ 159 733	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	0,03
Banque de développement de l'Afrique australe 8,600 % éch. 21/10/2024	07/10/2021	1 498	1 160	0,76
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. 21/01/2039	16/11/2018	5	0	0,00
		\$ 1 556	\$ 1 204	0,79

Un montant en numéraire de 1 722 \$ (31 décembre 2022 : 1 839 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	\$	135 341	\$	3 354	\$ 138 695
Fonds d'investissement		15 721		0		0	15 721
Contrats de mise en pension		0		3 949		0	3 949
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾		32		2 179		0	2 211
Dépôts auprès d'établissements de crédit		0		364		776	1 140
Totaux	\$	15 753	\$	141 833	\$	4 130	\$ 161 716

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate 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		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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ (141)	\$ 0	\$ (141)
BOA	598	(460)	138	92	(40)	52
BPS	771	(750)	21	(36)	0	(36)
BRC	(67)	0	(67)	(2)	0	(2)
BSH	3	0	3	S/O	S/O	S/O
CBK	109	0	109	1 221	(1 150)	71
DUB	(18)	0	(18)	S/O	S/O	S/O
GLM	(12)	0	(12)	1	0	1
GST	2	0	2	S/O	S/O	S/O
JPM	40	0	40	14	0	14
MBC	(38)	0	(38)	648	(550)	98
MYC	(1)	0	(1)	(5)	0	(5)
MYI	(93)	0	(93)	76	0	76
RBC	311	(280)	31	S/O	S/O	S/O
SCX	(12)	0	(12)	981	(940)	41
SOG	493	(370)	123	S/O	S/O	S/O
UAG	36	0	36	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	68,61	67,07
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	18,23	17,79
Fonds d'investissement	9,84	9,77
Contrats de mise en pension	2,47	4,96
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,41)	0,10
Instruments financiers dérivés compensés	0,46	0,50
Instruments financiers dérivés hors cote	1,33	1,66
Certificats de dépôt	0,71	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	1,81	1,15
Obligations et billets privés	70,23	70,02
Agences du gouvernement américain	1,90	0,76
Obligations du Trésor américain	4,23	3,90
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	0,71	0,77
Titres adossés à des actifs	0,89	0,84
Émissions souveraines	4,29	3,53
Actions ordinaires	0,20	0,52
Bons de souscription	0,00	0,00
Instruments à court terme	2,58	3,37
Fonds d'investissement	9,84	9,77
Contrats de mise en pension	2,47	4,96
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,41)	0,10
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	(0,01)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,08	0,20
Swaps de taux d'intérêt	0,38	0,31

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Instrument financiers dérivés hors cote		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,06)	(0,02)
Swaps de volatilité	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,20	(0,24)
Contrats de change à terme couverts	1,19	1,92
Certificats de dépôt	0,71	S/O
Autres actifs et passifs à court terme	(1,24)	(1,85)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets 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				RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				LUXEMBOURG																											
BRÉSIL				ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS																											
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Billets de la Banque centrale de République dominicaine				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.																											
Banco BTG Pactual S.A.	8,300	10 000	2,011	0,87	12,000 % éch. 03/10/2025	DOP	84 300	1 602	0,69	5,250 % éch. 23/05/2023 ^ (g)	\$	1 600	96	0,04																					
8,300 % éch. 15/08/2024	BRL				13,000 % éch. 05/12/2025		244 600	4 772	2,07	Tierra Mojada Luxembourg SARL			0	0,00																					
Oi S.A.		350	62	0,03	Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine				5,750 % éch. 01/12/2040																										
0,000 % éch. 25/02/2035					13,625 % éch. 03/02/2033		50 200	1 129	0,49	Total Luxembourg			96	0,04																					
Vale S.A.		46 580	2 969	1,29	13,625 % éch. 10/02/2034		56 700	1 295	0,56	MALAISIE																									
0,000 % (e)					Total République dominicaine				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS																										
Total Brésil			5 042	2,19	GUATEMALA				Khazanah Capital Ltd.																										
ÎLES CAIMANS				ÉMISSIONS SOUVERAINES				4,876 % éch. 01/06/2033																											
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Obligation internationale du gouvernement du Guatemala																															
Kaisa Group Holdings Ltd.		3 400	226	0,10	6,600 % éch. 13/06/2036	\$	900	907	0,39	ÉMISSIONS SOUVERAINES																									
9,375 % éch. 30/06/2024 ^	\$	700	47	0,02	HONGRIE				Obligation internationale du gouvernement malaisien																										
9,750 % éch. 28/09/2023 ^		200	13	0,01	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,800 % éch. 17/08/2023																										
11,700 % éch. 11/11/2025 ^					MVM Energetika Zrt				Total Malaisie																										
Poinsettia Finance Ltd.		797	658	0,28	7,500 % éch. 09/06/2028		600	599	0,26	MEXIQUE																									
6,625 % éch. 17/06/2031					ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS																										
Sunac China Holdings Ltd.		400	62	0,03	Banque de développement hongroise				Metalsa S.A. de C.V.																										
6,500 % éch. 09/07/2023 ^		200	30	0,01	6,500 % éch. 29/06/2028		2 200	2 182	0,95	3,750 % éch. 04/05/2031	\$	800	631	0,27																					
7,250 % éch. 14/06/2022 ^					Total Hongrie				2,781																										
Total Îles Caïmans			1 036	0,45	INDE				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS																										
CHILI				ÉMISSIONS SOUVERAINES				JWS Hydro Energy Ltd.																											
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos				4,125 % éch. 18/05/2031																											
6,000 % éch. 01/04/2033	CLP	6 390 000	8 433	3,66	IRLANDE				TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS																										
CHINE				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Black Diamond CLO DAC																											
Yango Justice International Ltd.		1 100	10	0,00	4,060 % éch. 20/01/2032	€	418	450	0,20	Cairn CLO DAC																									
7,500 % éch. 17/02/2025 ^	\$				3,957 % éch. 15/10/2031		800	856	0,37	Carlyle Euro CLO DAC																									
COLOMBIE				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.																											
Ecopetrol S.A.		700	480	0,21	4,073 % éch. 15/11/2031		1 394	1 489	0,65	Harvest CLO DAC																									
5,875 % éch. 28/05/2045					4,250 % éch. 26/06/2030		1 241	1 326	0,57	Oak Hill European Credit Partners DAC																									
CONGO				ÉMISSIONS SOUVERAINES				3,940 % éch. 20/10/2031																											
Obligation internationale congolaise				6,000 % éch. 30/06/2029				500				531				0,23																			
		625	529	0,23	RÉPUBLIQUE TCHÈQUE				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS																										
ÉMISSIONS SOUVERAINES				EP Infrastructure A/S				1,816 % éch. 02/03/2031				€				1 400				1 073				0,47											
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Obligation internationale du gouvernement de République tchèque				2,000 % éch. 13/10/2033				CZK				19 400				723				0,31											
					2,750 % éch. 23/07/2029		49 000	2 050	0,89	ÉMISSIONS SOUVERAINES				Sovcombank Via SovCom Capital DAC																					
					2 773				1,20				8,000 % éch. 07/04/2030 ^ (g)				400				24				0,01										
					3 846				1,67				78				0,04																		
Total République tchèque												6 044				2,62																			
DANEMARK				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX																							
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		0	0	0,00	European Loan Conduit DAC				4,358 % éch. 17/02/2030				€				287				306				0,13										
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK				Total Irlande				6 428				2,79																						
1,500 % éch. 01/10/2053					ISRAËL				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS																										
Nykredit Realkredit A/S		0	0	0,00	Bank Leumi Le-Israel B.M.				7,129 % éch. 18/07/2033 (g)				\$				400				396				0,17										
1,000 % éch. 01/10/2050					ÉMISSIONS SOUVERAINES				Obligation internationale du gouvernement israélien				0,150 % éch. 31/07/2023				ILS				20 800				5 584				2,42						
1,500 % éch. 01/10/2053					Total Israël				5 980				2,59																						
Realkredit Danmark A/S		0	0	0,00	CÔTE D'IVOIRE				CREDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS																										
1,000 % éch. 01/10/2050					République de Côte d'Ivoire				7,985 % éch. 19/03/2027				€				800				851				0,37										
1,500 % éch. 01/10/2053					Total Danemark				546				0,24																						
TDC Net A/S		500	546	0,24	PANAMA				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS																										
6,500 % éch. 01/06/2031	€				Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.				5,125 % éch. 11/09/2061				\$				600				463				0,20										
Total Danemark			546	0,24	PARAGUAY				ÉMISSIONS SOUVERAINES																										
PARAGUAY				ÉMISSIONS SOUVERAINES				Obligation internationale du gouvernement paraguayen				5,850 % éch. 21/08/2033 (a)				500				501				0,22											
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				PÉROU				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Banco de Credito del Peru S.A.				4,650 % éch. 17/09/2024				PEN				2 600				688				0,30			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Obligation internationale du gouvernement péruvien				5,940 % éch. 12/02/2029				700				190				0,08															
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				6,950 % éch. 12/08/2031				200				56				0,02																			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				7,300 % éch. 12/08/2033				33 800				9 628				4,18																			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Pérou				10 562				4,58																							
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				POLOGNE				ÉMISSIONS SOUVERAINES																											
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Bank Gospodarstwa Krajowego				5,375 % éch. 22/05/2033				\$				1 200				1 195				0,52											

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities 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	
SSB	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 939	Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 30/06/2026	\$ (958)	\$ 939	\$ 939	0,41	
Total des Contrats de mise en pension							\$ (958)	\$ 939	\$ 939	0,41

⁽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	09/2023	2	\$ 1	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Long	09/2023	47	(29)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	554	(1 102)	(0,48)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	18	37	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	1	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	75	(123)	(0,05)
				\$ (1 215)	(0,53)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (1 215)	(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
Newell Brands, Inc.	1,000 %	20/06/2028	\$ 700	\$ 5	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.EM-39 à 5 ans	1,000 %	20/06/2028	\$ 23 900	\$ 439	0,19
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	22 200	155	0,07
				\$ 594	0,26

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⁾	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,000 %	20/09/2028	INR 1 577 940	\$ 77	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	16/09/2023	\$ 9 300	(133)	(0,06)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	16/06/2031	2 500	363	0,16
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	16/12/2025	7 900	(846)	(0,37)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	17/06/2025	400	(35)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	17/06/2030	3 070	(573)	(0,25)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/12/2050	1 500	594	0,26
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/06/2051	6 800	1 467	0,64
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/06/2051	4 500	920	0,40
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	21/06/2024	7 100	(117)	(0,05)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	18/12/2024	270	15	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	18/12/2029	4 100	447	0,19
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,562	14/02/2024	22 300	811	0,35
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/12/2031	2 700	440	0,19

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	5,580 %	02/01/2025	BRL 10 000	\$ (261)	(0,11)
À payer	CDI BRL à 1 an	6,220	02/01/2025	4 600	(89)	(0,04)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,745	02/01/2025	10 500	143	0,06
À payer	CDI BRL à 1 an	6,950	04/01/2027	8 300	(148)	(0,06)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,570	04/01/2027	11 900	167	0,07
À payer	CDI BRL à 1 an	8,615	02/01/2025	6 000	(25)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,120	04/01/2027	2 500	(13)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,206	04/01/2027	9 400	(43)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,446	04/01/2027	28 200	(79)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,565	04/01/2027	45 800	60	0,03
À payer	CDI BRL à 1 an	10,665	02/01/2024	5 800	(44)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,755	02/01/2024	22 000	(159)	(0,07)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	10,800	02/01/2024	51 900	363	0,16
À payer	CDI BRL à 1 an	10,833	02/01/2024	31 800	(221)	(0,10)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,995	02/01/2024	15 300	(96)	(0,04)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,055	04/01/2027	22 200	16	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,065	02/01/2024	10 600	(63)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,148	02/01/2024	2 600	(15)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,170	04/01/2027	24 800	(43)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,400	04/01/2027	15 500	92	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	11,410	04/01/2027	15 500	93	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	11,420	02/01/2026	38 300	174	0,07
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,810	02/01/2025	65 900	(93)	(0,04)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,890	02/01/2025	88 400	36	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,905	04/01/2027	37 800	(312)	(0,14)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,920	02/01/2024	99 100	377	0,16
À payer	CDI BRL à 1 an	12,005	02/01/2025	22 100	15	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,090	04/01/2027	25 200	(73)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,091	04/01/2027	21 700	195	0,08
À payer	CDI BRL à 1 an	12,210	02/01/2025	15 500	23	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	12,290	02/01/2024	54 800	(203)	(0,09)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,350	01/07/2024	52 300	(27)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,490	01/07/2024	56 100	(44)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,533	02/01/2029	16 000	(209)	(0,09)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,595	01/07/2024	46 000	51	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	12,684	02/01/2029	19 000	264	0,11
À payer	CDI BRL à 1 an	12,746	02/01/2029	20 500	292	0,13
À payer	CDI BRL à 1 an	12,940	04/01/2027	27 000	345	0,15
À payer	CDI BRL à 1 an	13,080	01/07/2024	100 300	198	0,09
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,218	02/01/2029	39 300	(664)	(0,29)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	16/03/2027	CNY 35 200	(50)	(0,02)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	15/03/2028	71 500	14	0,01
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	21/06/2028	101 900	17	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,690	24/07/2024	COP 7 257 000	175	0,08
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,740	24/07/2024	7 084 900	(169)	(0,07)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,100	26/11/2025	2 651 000	81	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,060	26/11/2025	14 071 000	360	0,16
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,110	23/03/2026	4 493 200	(101)	(0,04)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,651	26/11/2025	2 624 800	(59)	(0,03)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,050	16/07/2026	34 330 400	(810)	(0,35)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,130	26/10/2026	25 320 800	405	0,18
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,885	31/01/2025	24 609 000	311	0,13
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,080	02/02/2027	1 622 900	14	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,090	28/04/2028	1 750 200	9	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,130	31/01/2027	8 865 000	74	0,03
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	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,320	31/03/2027	2 908 000	9	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,560	30/03/2027	4 424 200	22	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,686	30/03/2027	26 334 600	154	0,07
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	(216)	(0,09)
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	35 000 000	592	0,26
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,800	17/01/2028	9 809 000	172	0,07
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,265	12/04/2025	41 439 000	(73)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,640	21/10/2025	11 114 000	(149)	(0,06)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,930	10/11/2025	5 929 100	92	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,000	26/11/2025	427 000	(7)	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,060	09/11/2025	4 198 000	68	0,03
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2033	KRW 13 900 100	(97)	(0,04)
À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	15/03/2028	THB 234 710	(67)	(0,03)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	16/09/2023	\$ 9 300	134	0,06
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/09/2023	7 900	(93)	(0,04)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/09/2023	6 000	66	0,03
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/09/2023	3 470	(37)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/09/2023	4 370	44	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	21/09/2023	7 100	(73)	(0,03)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	15/09/2023	2 700	26	0,01
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,757	14/04/2026	ZAR 96 300	(360)	(0,16)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	0,905	24/11/2023	CLP 1 293 300	73	0,03

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 notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,070 %	10/12/2023	CLP 1 218 000	\$ (65)	(0,03)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,080	10/12/2023	1 218 000	(64)	(0,03)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,090	10/12/2023	2 828 000	(158)	(0,07)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,345	11/06/2025	1 350 000	167	0,07
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,947	23/11/2027	999 000	176	0,08
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,950	05/05/2026	1 239 600	(180)	(0,08)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,965	24/11/2027	851 000	147	0,06
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,020	30/04/2026	1 300 000	(188)	(0,08)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,183	04/12/2027	2 661 000	(436)	(0,19)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,360	22/01/2025	1 099 200	(149)	(0,06)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,640	01/03/2026	795 000	110	0,05
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,530	06/07/2026	1 995 000	250	0,11
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,000	06/07/2028	1 019 000	111	0,05
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,130	01/03/2025	1 820 000	115	0,05
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,180	01/10/2028	790 000	17	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,240	01/09/2030	1 286 000	15	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,260	01/03/2026	620 000	27	0,01
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	30	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,470	01/09/2030	460 000	(4)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,548	10/04/2028	833 000	(2)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,570	01/10/2028	245 000	(5)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,589	10/04/2028	1 694 000	(1)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,600	12/12/2027	1 803 000	(16)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,635	12/12/2027	3 695 000	(39)	(0,02)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,700	17/05/2028	1 602 100	(23)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,720	28/01/2025	4 012 000	225	0,10
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,734	18/05/2028	9 093 000	(150)	(0,07)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,754	28/01/2025	3 238 000	175	0,08
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,760	28/01/2025	1 933 000	104	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,915	01/02/2025	3 534 300	181	0,08
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,020	02/03/2029	190 000	8	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,070	28/02/2028	3 391 700	(60)	(0,03)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,194	10/03/2028	1 681 200	47	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,223	13/03/2028	680 300	23	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,255	13/03/2028	478 200	15	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,270	02/03/2027	415 700	7	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,330	09/03/2028	526 800	19	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,360	25/05/2027	24 600	2	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,386	24/05/2027	1 861 000	59	0,03
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,440	07/03/2028	1 344 000	53	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,500	12/12/2025	2 564 000	(19)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,535	09/01/2026	9 540 000	(163)	(0,07)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,567	12/12/2025	1 464 000	(12)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,570	22/12/2025	1 277 000	(18)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,590	22/12/2025	3 565 000	(40)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,590	21/03/2027	4 540 300	49	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,805	06/03/2027	1 852 000	63	0,03
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,000	27/09/2032	1 785 800	301	0,13
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,265	07/03/2026	262 400	9	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,270	07/03/2026	2 463 000	57	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,370	06/03/2026	1 686 000	42	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,690	10/05/2025	7 125 500	7	0,00
À payer ⁽³⁾	PRIBOR CZK à 6 mois	1,025	29/07/2030	CZK 35 800	(171)	(0,07)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,224	28/01/2031	44 500	(439)	(0,19)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,575	26/03/2026	28 100	(136)	(0,06)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,725	22/07/2026	23 800	(118)	(0,05)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,815	28/01/2031	34 200	276	0,12
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	2,000	19/06/2024	26 100	(68)	(0,03)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	3,490	18/01/2032	10 600	32	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	3,680	03/03/2027	78 400	135	0,06
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,164	14/03/2027	73 600	105	0,05
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,220	14/03/2027	73 500	98	0,04
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,300	18/03/2027	143 400	(140)	(0,06)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,310	15/03/2027	19 100	22	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,320	15/03/2027	7 200	8	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,560	14/07/2032	111 300	(112)	(0,05)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,611	06/06/2028	248 000	(80)	(0,03)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,640	18/05/2028	64 400	7	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,740	28/02/2033	91 700	160	0,07
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,040	17/04/2028	27 900	22	0,01
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,100	18/04/2028	11 800	11	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,110	22/03/2026	72 500	30	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,125	22/03/2026	50 000	20	0,01
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,480	15/03/2026	216 500	4	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,606	28/06/2027	54 800	80	0,03
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	15/12/2040	€ 300	141	0,06
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	600	16	0,01
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	1 500	(5)	0,00
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,500	19/06/2024	HUF 1 427 600	(480)	(0,21)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,760	21/01/2030	380 000	372	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	BBR HUF à 6 mois	1,958 %	19/03/2026	HUF 398 600	\$ (239)	(0,10)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	5,500	04/03/2027	2 382 600	804	0,35
À payer	BBR HUF à 6 mois	6,280	18/03/2027	2 363 300	(556)	(0,24)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	13,600	12/12/2024	1 418 700	(353)	(0,15)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,110	12/01/2031	PLN 9 800	640	0,28
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,165	28/01/2031	4 400	(131)	(0,06)
À recevoir ⁽³⁾	WIBOR PLN à 6 mois	1,215	29/07/2030	10 300	338	0,15
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,855	28/01/2031	6 000	(316)	(0,14)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,933	17/01/2025	11 800	(289)	(0,13)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	2,635	28/10/2026	32 900	(244)	(0,11)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	3,035	09/12/2026	42 000	560	0,24
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,075	07/03/2027	28 700	277	0,12
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	4,830	18/03/2027	28 300	(48)	(0,02)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	4,895	17/03/2027	15 000	(54)	(0,02)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	4,920	17/03/2027	15 000	(51)	(0,02)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,300	25/04/2028	11 900	(54)	(0,02)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,670	28/06/2027	14 400	194	0,08
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,725	27/06/2027	20 700	(289)	(0,13)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,843	28/06/2027	1 500	22	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,310	30/06/2027	11 000	(210)	(0,09)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,080	16/06/2025	MXN 16 400	(82)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,700	12/09/2030	35 400	(271)	(0,12)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,770	09/10/2030	150 700	1 127	0,49
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,850	19/08/2030	12 100	(89)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,875	16/08/2030	16 800	(119)	(0,05)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,880	16/08/2030	8 700	(61)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,920	16/08/2030	9 100	(63)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,240	10/07/2026	113 600	(441)	(0,19)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,480	28/05/2040	16 700	(34)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,495	17/07/2026	140 500	541	0,23
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,505	17/07/2026	102 100	392	0,17
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,580	01/01/2025	29 700	(93)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,830	27/12/2029	19 900	(77)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,570	19/11/2026	145 200	(463)	(0,20)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,675	04/06/2029	65 100	(103)	(0,05)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,465	16/08/2027	167 300	22	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,480	24/03/2027	121 900	(74)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,560	18/05/2028	14 500	(6)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,585	18/05/2028	14 700	(7)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,600	18/05/2028	7 400	(4)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,610	18/05/2028	7 600	(4)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,645	18/05/2028	7 600	(5)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,656	18/05/2028	17 300	(12)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,700	05/11/2027	8 700	4	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,740	07/03/2028	192 900	(194)	(0,08)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,743	05/11/2027	37 900	21	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,760	05/11/2027	25 400	15	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,773	05/11/2027	20 000	12	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,045	04/11/2027	17 200	20	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,053	04/11/2027	18 900	23	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,117	04/11/2027	47 100	63	0,03
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,165	05/11/2026	25 600	15	0,01
					\$ 4 668	2,02
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 5 267	2,28

(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.

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 de vente - EUR contre CZK hors cote	CZK 23,830	01/11/2023	802	\$ 84	\$ 356	0,15
GLM	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF 385,000	01/11/2023	203	27	123	0,05
	Option de vente - EUR contre PLN hors cote	PLN 4,560	01/11/2023	403	48	317	0,14
JPM	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF 385,000	01/11/2023	403	39	243	0,11
MYI	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN 18,500	25/07/2023	4 228	106	313	0,14
UAG	Option d'achat - USD contre ZAR hors cote	ZAR 20,500	09/10/2023	6 748	94	68	0,03
					\$ 398	\$ 1 420	0,62

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

OPTIONS DOUBLES (STRADDLE)

Contrepartie	Description	Niveau d'exercice ⁽²⁾	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Coût ⁽²⁾	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600 %	27/12/2023	2 800	\$ 0	\$ 1	0,00
	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	15,050	27/12/2023	2 800	0	3	0,00
CBK	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	15,100	20/12/2023	8 800	0	1	0,00
	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600	29/12/2023	2 600	0	0	0,00
MYI	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600	27/12/2023	3 900	0	1	0,00
					\$ 0	\$ 6	0,00

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
MYI	Option d'achat - USD contre CLP hors cote	CLP 850,000	18/07/2023	2 436	\$ (34)	\$ (3)	0,00
	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN 17,750	25/07/2023	8 456	(54)	(275)	(0,12)
	Option d'achat - USD contre MXN hors cote	21,000	07/03/2024	4 072	(91)	(29)	(0,01)
					\$ (179)	\$ (307)	(0,13)

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

(2) Niveau d'exercice et coût final déterminés à une date future sur la base des paramètres implicites de volatilité.

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
BOA	Obligation internationale du gouvernement brésilien	(1,000) %	20/12/2024	\$ 1 800	\$ 27	\$ (43)	\$ (16)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/06/2024	400	24	(16)	8	0,01
BPS	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/06/2024	1 400	65	(38)	27	0,01
BRC	Obligation internationale du gouvernement brésilien	(1,000)	20/12/2024	1 000	16	(25)	(9)	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement mexicain	(1,000)	20/12/2024	100	(1)	0	(1)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2024	200	12	(4)	8	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement mexicain	(1,000)	20/12/2024	2 000	(23)	2	(21)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/06/2024	6 500	304	(176)	128	0,06
HUS	Obligation internationale du gouvernement mexicain	(1,000)	20/12/2024	1 100	(13)	1	(12)	(0,01)
JPM	Obligation internationale du gouvernement brésilien	(1,000)	20/12/2024	3 200	63	(91)	(28)	(0,01)
					\$ 474	\$ (390)	\$ 84	0,04

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
BPS	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000 %	20/12/2023	\$ 200	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	1 200	(84)	31	(53)	(0,02)
GST	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/06/2024	400	2	1	3	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20/12/2024	600	(14)	9	(5)	0,00
					\$ (96)	\$ 41	\$ (55)	(0,02)

(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 CROISÉS

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 0,672 % 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	20/09/2028	INR 177 590	\$ 2 160	\$ 4	\$ 2	\$ 6	0,00

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 0,282 % 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	\$ 97	\$ 97	0,04
JPM	Taux variable égal à LIBOR INR à 3 mois plus 0,672 % 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	20/09/2028	INR 709 400	\$ 8 637	4	(23)	(19)	(0,01)
SCX	Taux variable égal à LIBOR INR à 3 mois plus 0,664 % 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	20/09/2028	180 040	2 190	4	2	6	0,00
SCX	Taux variable égal à LIBOR INR à 3 mois plus 0,664 % 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	20/09/2028	438 090	5 338	5	(14)	(9)	0,00
						\$ 17	\$ 64	\$ 81	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
BOA	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750 %	15/06/2027	MYR 21 600	\$ (38)	\$ 57	\$ 19	0,01
BPS	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	2,670	16/06/2026	10 600	0	(62)	(62)	(0,03)
JPM	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,020	06/06/2024	CLP 770 000	0	(55)	(55)	(0,02)
MYC	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,000	15/12/2026	MYR 13 400	3	58	61	0,03
MYI	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,340	18/09/2029	3 500	0	(17)	(17)	(0,01)
SCX	À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,430	06/03/2025	CNY 25 600	0	23	23	0,01
	À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	3,020	04/02/2025	26 000	0	41	41	0,02
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	2,750	15/09/2026	MYR 3 700	11	(33)	(22)	(0,01)
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,230	23/08/2024	6 500	0	7	7	0,00
UAG	À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,920	15/01/2025	CNY 43 900	0	90	90	0,04
						\$ (24)	\$ 109	\$ 85	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	
BOA	07/2023	DKK	1 623	\$ 234	\$ 0	\$ (3)	(3)	0,00
	07/2023	INR	368 549	4 581	94	0	94	0,04
	07/2023	KES	81 859	578	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	MXN	165 028	8 964	0	(634)	(634)	(0,28)
	07/2023	PLN	1 742	418	0	(11)	(11)	0,00
	07/2023	\$	433	DKK 2 943	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023		4 572	INR 368 549	0	(85)	(85)	(0,04)
	07/2023		199	PLN 823	3	0	3	0,00
	08/2023	AUD	308	\$ 208	3	0	3	0,00
	08/2023	DKK	2 939	433	2	0	2	0,00
	08/2023	€	992	1 065	0	(20)	(20)	(0,01)
	08/2023	¥	291 300	2 108	80	0	80	0,03
	08/2023	MXN	19 292	1 044	0	(73)	(73)	(0,03)
	08/2023	\$	1 061	CNY 7 281	0	(54)	(54)	(0,02)
	08/2023		142	EGP 4 728	6	0	6	0,00
	08/2023		1 528	€ 1 406	9	0	9	0,00
	08/2023	ZAR	108 235	\$ 5 782	75	0	75	0,03
	09/2023	KRW	4 273	3	0	0	0	0,00
	09/2023	NGN	56 791	98	26	0	26	0,01
	09/2023	PEN	17 182	4 685	0	(27)	(27)	(0,01)
	09/2023	TWD	22 335	736	17	0	17	0,01
	09/2023	\$	10	NGN 7 760	0	0	0	0,00
	09/2023		4 439	PEN 16 471	78	0	78	0,03
	10/2023		114	KES 17 190	4	0	4	0,00
	10/2023	ZAR	17 796	\$ 959	26	0	26	0,01
BPS	07/2023	CZK	63 184	2 937	38	0	38	0,02
	07/2023	PHP	5 138	91	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	PLN	468	113	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$	3 038	MYR 13 943	0	(45)	(45)	(0,02)
	07/2023		22	PLN 91	0	0	0	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
	08/2023	CNH	13 452	\$ 1 955	\$ 99	\$ 99	0,04
	08/2023	MYR	14 815	3 189	5	5	0,00
	08/2023	TWD	11 180	366	7	7	0,00
	08/2023	\$	2 372	CNY 16 273	0	(121)	(0,05)
	08/2023		1 208	COP 5 426 193	80	80	0,03
	08/2023		2 294	€ 2 092	0	(7)	0,00
	08/2023	ZAR	621	\$ 33	1	1	0,00
	09/2023	PEN	11 310	\$ 3 090	0	(11)	(0,00)
	09/2023	\$	91	PHP 5 138	2	2	0,00
	09/2023		0	THB 9	0	0	0,00
	10/2023		1 387	ZAR 27 192	37	37	0,02
	10/2023	ZAR	39 034	\$ 2 099	54	54	0,02
	12/2023	NGN	14 580	18	0	0	0,00
	12/2023	\$	4 502	MXN 80 258	39	39	0,02
BRC	07/2023	BRL	11 242	\$ 2 343	13	13	0,01
	07/2023	¥	3 144 000	24 308	2 513	2 513	1,09
	07/2023	\$	2 317	MYR 10 643	0	(32)	(0,01)
	08/2023	COP	5 597 988	\$ 1 314	0	(10)	0,00
	08/2023	\$	2 024	£ 1 612	27	27	0,01
	08/2023		283	¥ 37 513	0	(22)	(0,01)
	08/2023	ZAR	129 385	\$ 6 550	1	(270)	(0,12)
	09/2023	ILS	2 436	681	23	23	0,01
	09/2023	\$	1 804	MXN 31 492	6	6	0,00
CBK	10/2023	MXN	70 947	\$ 3 787	0	(270)	(0,12)
	07/2023	CLP	13 318 245	16 456	0	(128)	(0,06)
	07/2023	CZK	55 760	2 588	29	29	0,01
	07/2023	ILS	20 381	5 868	372	372	0,16
	07/2023	MXN	43 942	2 529	0	(29)	(0,01)
	07/2023	PLN	9 114	2 181	0	(60)	(0,03)
	07/2023	\$	1 215	BRL 5 633	0	(6)	0,00
	07/2023		591	COP 2 696 790	51	51	0,02
	07/2023		94	PHP 5 138	0	(1)	0,00
	07/2023		34	PLN 137	0	0	0,00
	07/2023		4 157	RON 18 796	0	(24)	(0,01)
	07/2023		209	UYU 8 254	12	12	0,01
	07/2023	UYU	8 254	\$ 220	0	(1)	0,00
	08/2023	BRL	6 565	1 270	0	(84)	(0,04)
	08/2023	CAD	31	23	0	0	0,00
	08/2023	CLP	1 097 369	1 325	0	(39)	(0,02)
	08/2023	CNY	6 135	890	42	42	0,02
	08/2023	COP	1 959 460	463	0	0	0,00
	08/2023	EGP	11 401	329	0	(29)	(0,01)
	08/2023	€	1 582	1 700	0	(30)	(0,01)
	08/2023	PEN	7 977	2 042	0	(151)	(0,07)
	08/2023	TWD	11 639	381	7	7	0,00
	08/2023	\$	9 726	CLP 7 958 093	123	123	0,05
	08/2023		216	CNH 1 509	0	(8)	0,00
	08/2023		1 419	€ 1 295	0	(4)	0,00
	08/2023		333	£ 263	2	2	0,00
	09/2023	COP	413 251	\$ 98	1	1	0,00
	09/2023	KRW	8 866	7	0	0	0,00
	09/2023	MXN	39 108	2 099	0	(146)	(0,06)
	09/2023	PHP	111 257	1 975	0	(33)	(0,01)
	09/2023	\$	7 443	IDR 111 078 693	0	(65)	(0,03)
	09/2023		4 199	INR 348 032	31	31	0,01
	09/2023	ZMW	14 094	\$ 803	16	16	0,01
	10/2023	\$	97	NGN 58 212	0	(25)	(0,01)
	02/2024	EGP	6 270	\$ 167	0	(1)	0,00
DUB	02/2024	\$	409	EGP 14 313	0	(26)	(0,01)
	07/2023		700	KES 101 607	19	19	0,01
	10/2023		252	NGN 149 289	0	(66)	(0,03)
	10/2023	ZAR	13 689	\$ 752	35	35	0,02
FAR	02/2024	\$	2 218	EGP 77 705	0	(134)	(0,06)
GLM	10/2023		3 047	ZAR 59 715	81	81	0,04
	07/2023	BRL	35 370	\$ 7 082	0	(250)	(0,11)
	07/2023	DOP	215 614	3 725	0	(132)	(0,06)
	07/2023	RON	756	168	1	1	0,00
	07/2023	\$	7 897	BRL 40 783	568	(11)	0,24
	07/2023		104	MXN 1 803	1	1	0,00
	07/2023		202	PLN 856	8	8	0,00
	07/2023		159	RON 719	0	(1)	0,00
	08/2023	BRL	5 517	\$ 1 149	11	11	0,00
	08/2023	DOP	89 524	1 555	0	(51)	(0,02)
	08/2023	\$	1 699	CHF 1 504	0	(11)	0,00
	08/2023	ZAR	44 848	\$ 2 417	52	52	0,02
	09/2023	\$	4 973	BRL 24 276	4	4	0,00
	09/2023		4 688	THB 161 733	0	(92)	(0,04)
	09/2023		2 005	TWD 61 018	0	(42)	(0,02)
	10/2023	DOP	81 364	\$ 1 450	7	7	0,00
	10/2023	NGN	287 412	513	156	156	0,07
	10/2023	ZAR	34 001	1 812	32	32	0,01
	11/2023	€	3 075	PLN 13 819	5	5	0,00
	07/2023	DKK	4 770	\$ 689	0	(10)	0,00
IND	11/2023	€	443	HUF 205 188	98	98	0,04
	06/2024	\$	815	TWD 20 969	0	(122)	(0,05)

Contrepartie	Mois de 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	07/2023	\$ 4 382	MXN 77 122	\$ 107	\$ 0	\$ 107	0,05	
	07/2023	75	NGN 41 102	0	(22)	(22)	(0,01)	
	07/2023	49	PLN 207	2	0	2	0,00	
	07/2023	78	SGD 103	0	(2)	(2)	0,00	
	08/2023	BRL 21 667	\$ 4 228	0	(242)	(242)	(0,11)	
	08/2023	CAD 51	38	0	0	0	0,00	
	08/2023	CNH 3 945	571	27	0	27	0,01	
	08/2023	COP 1 102 429	260	0	(2)	(2)	0,00	
	08/2023	£ 2 412	3 055	0	(12)	(12)	(0,01)	
	08/2023	HUF 1 006 288	2 883	1	(25)	(24)	(0,01)	
	08/2023	\$ 2 560	CHF 2 251	0	(33)	(33)	(0,01)	
	08/2023	1 321	CNY 9 032	0	(71)	(71)	(0,03)	
	08/2023	199	EGP 6 673	10	0	10	0,00	
	08/2023	5 951	€ 5 434	0	(10)	(10)	0,00	
	08/2023	46	¥ 6 165	0	(3)	(3)	0,00	
	08/2023	2 064	MXN 35 765	4	0	4	0,00	
	08/2023	2 564	ZAR 49 713	67	(11)	56	0,02	
	08/2023	ZAR 2 121	\$ 109	0	(3)	(3)	0,00	
	09/2023	COP 730 861	172	0	0	0	0,00	
	09/2023	ILS 2 338	658	26	0	26	0,01	
	09/2023	INR 385 462	4 685	0	0	0	0,00	
	09/2023	THB 51 883	1 513	39	0	39	0,02	
	09/2023	\$ 83	NGN 49 296	0	(21)	(21)	(0,01)	
	09/2023	1 963	PEN 7 229	19	0	19	0,01	
	09/2023	1 414	THB 48 585	0	(34)	(34)	(0,01)	
	10/2023	MXN 129 137	\$ 7 355	0	(30)	(30)	(0,01)	
	10/2023	\$ 128	NGN 79 447	0	(30)	(30)	(0,01)	
	11/2023	HUF 205 375	€ 443	0	(98)	(98)	(0,04)	
	12/2023	NGN 67 068	\$ 108	26	0	26	0,01	
	12/2023	\$ 130	NGN 81 907	0	(30)	(30)	(0,01)	
	01/2024	50	EGP 1 641	0	(5)	(5)	0,00	
	02/2024	EGP 47 299	\$ 1 248	0	(20)	(20)	(0,01)	
	04/2024	KES 133 703	870	0	(13)	(13)	(0,01)	
	MBC	07/2023	\$ 1	KES 146	0	0	0	0,00
		07/2023	21	PLN 89	1	0	1	0,00
08/2023		€ 8 529	\$ 9 412	87	0	87	0,04	
08/2023		HUF 2 616 833	7 669	109	0	109	0,05	
08/2023		¥ 1 470 000	10 760	517	0	517	0,22	
08/2023		\$ 134	€ 122	0	0	0	0,00	
08/2023		952	ZAR 18 547	26	0	26	0,01	
09/2023		KRW 7 923	\$ 6	0	0	0	0,00	
09/2023		\$ 1 103	INR 91 298	7	0	7	0,00	
09/2023		52	THB 1 772	0	(1)	(1)	0,00	
01/2024		64	EGP 2 100	0	(6)	(6)	0,00	
MYI		07/2023	CZK 53 519	\$ 2 428	2	(30)	(28)	(0,01)
		07/2023	€ 2	2	0	0	0	0,00
		07/2023	PLN 431	100	0	(6)	(6)	0,00
		07/2023	\$ 199	COP 840 548	1	0	1	0,00
	07/2023	385	DKK 2 625	0	0	0	0,00	
	07/2023	14	€ 13	0	0	0	0,00	
	07/2023	29	MYR 132	0	0	0	0,00	
	07/2023	141	PLN 596	5	0	5	0,00	
	08/2023	DKK 2 621	\$ 385	0	0	0	0,00	
	08/2023	€ 1 355	1 469	0	(12)	(12)	(0,01)	
	08/2023	TWD 12 030	397	10	0	10	0,00	
	08/2023	\$ 1 464	€ 1 352	14	0	14	0,01	
	08/2023	4 042	¥ 537 176	0	(303)	(303)	(0,13)	
	08/2023	5	TWD 157	0	0	0	0,00	
	08/2023	179	ZAR 3 493	5	0	5	0,00	
09/2023	THB 23 649	\$ 691	19	0	19	0,01		
09/2023	\$ 4 432	IDR 65 926 864	0	(53)	(53)	(0,02)		
09/2023	6 498	THB 222 630	0	(171)	(171)	(0,07)		
10/2023	ZAR 408	\$ 22	1	0	1	0,00		
01/2024	EGP 18 824	507	0	(7)	(7)	0,00		
01/2024	NGN 116 850	190	50	0	50	0,02		
01/2024	\$ 306	EGP 10 285	0	(26)	(26)	(0,01)		
02/2024	EGP 38 449	\$ 923	0	(109)	(109)	(0,05)		
RBC	07/2023	\$ 4 622	MXN 88 927	555	0	555	0,24	
	08/2023	£ 466	\$ 589	0	(4)	(4)	0,00	
	08/2023	\$ 15 174	MXN 262 971	35	0	35	0,02	
	09/2023	2 206	PEN 8 088	12	0	12	0,01	
SCX	07/2023	NGN 50 237	\$ 95	30	0	30	0,01	
	07/2023	\$ 3 045	MYR 13 996	0	(41)	(41)	(0,02)	
	07/2023	12	NGN 9 216	0	0	0	0,00	
	08/2023	CNH 1 870	\$ 272	14	0	14	0,01	
	08/2023	\$ 3 513	CNY 23 983	0	(195)	(195)	(0,08)	
	09/2023	PEN 23 124	\$ 6 277	0	(64)	(64)	(0,03)	
	09/2023	THB 53 690	1 555	29	0	29	0,01	
	09/2023	TWD 18 663	612	12	0	12	0,01	
	09/2023	\$ 3 084	INR 255 716	24	0	24	0,01	
	12/2023	449	KES 66 039	1	0	1	0,00	
	01/2024	0	EGP 13	0	0	0	0,00	
	01/2024	142	NGN 116 724	0	(2)	(2)	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
	06/2024	KES	68 980	\$	449	\$ 0	0,00
SOG	07/2023	PLN	53 350		12 384	\$ (1)	(0,32)
	07/2023	RON	9 512		2 110	0	0,01
	09/2023	\$	1 103	COP	4 692 294	0	0,00
	01/2024		147	EGP	4 785	0	(0,01)
SSB	07/2023		16 603	CLP	13 337 338	5	0,00
	08/2023	CLP	13 375 858	\$	16 603	1	0,00
	09/2023	\$	6 819	BRL	34 571	268	0,12
TOR	08/2023		1 866	¥	247 402	0	(0,06)
UAG	07/2023	¥	505 000	\$	3 852	357	0,15
	07/2023	PLN	397		97	0	0,00
	08/2023	CNY	1 122		163	8	0,00
	08/2023	£	2 113		2 670	0	(0,01)
	09/2023	ILS	2 023		565	18	0,01
	09/2023	SGD	5 607		4 195	40	0,02
	10/2023	\$	981	ZAR	18 020	0	(0,02)
						\$ 7 742	0,66
						\$ (6 212)	
						\$ 1 530	

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€	3 038	\$	3 286	\$ (28)	(0,01)
	07/2023	THB	17 888		503	0	0,00
	07/2023	\$	0	BRL	1	0	0,00
	07/2023		6 085	€	5 662	92	0,04
	08/2023		504	THB	17 888	2	0,00
BPS	07/2023	BRL	0	\$	0	0	0,00
	07/2023	CNY	17 239		2 386	11	0,01
	07/2023	€	24 212		26 529	114	0,05
	07/2023	\$	25 374	€	23 603	378	0,16
	08/2023		2 386	CNY	17 215	0	0,00
	08/2023		26 555	€	24 202	0	(0,05)
BRC	07/2023		2 850	PLN	12 033	112	0,05
BSH	07/2023		6		24	0	0,00
CBK	07/2023	€	2	\$	3	0	0,00
	07/2023	INR	52		1	0	0,00
	07/2023	MXN	20 510		1 193	0	(0,00)
	07/2023	\$	100	BRL	477	0	(0,00)
	07/2023		391	€	362	3	0,00
	07/2023		1 140	MXN	20 510	56	0,02
	07/2023		295	TRY	7 190	0	(0,01)
	08/2023	BRL	477	\$	99	1	0,00
	08/2023	\$	1 187	MXN	20 510	3	0,00
GLM	07/2023	BRL	479	\$	96	0	(0,00)
	07/2023	\$	346	RON	1 604	7	0,00
	07/2023		518	THB	17 888	0	(0,01)
JPM	07/2023	€	22 383	\$	24 440	20	0,01
	07/2023	INR	137 691		1 663	0	(0,01)
	07/2023	\$	1 679	INR	137 810	1	0,00
	08/2023	INR	137 936	\$	1 679	0	(0,00)
	08/2023	\$	24 475	€	22 383	0	(0,01)
MBC	07/2023	€	3 950	\$	4 263	0	(0,02)
	07/2023	\$	17	CNY	120	0	0,00
	07/2023		397	€	367	4	0,00
	07/2023		233	£	188	6	0,00
MYI	07/2023	PLN	12 063	\$	2 978	9	0,00
	07/2023	TRY	1		0	0	0,00
	07/2023	\$	343	IDR	5 171 080	2	0,00
	08/2023	IDR	5 173 035	\$	343	0	(0,00)
	08/2023	\$	2 978	PLN	12 080	0	(0,00)
SCX	07/2023		0	IDR	7 297	0	0,00
SOG	07/2023		25 381	€	23 594	360	0,16
TOR	07/2023	£	188	\$	239	0	0,00
	08/2023	\$	239	£	188	0	0,00
UAG	07/2023	IDR	5 151 443	\$	343	0	0,00
	07/2023	\$	2 442	CNY	17 166	0	(0,03)
						\$ 1 181	0,35
						\$ (364)	
						\$ 817	

Au 30 juin 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	07/2023	£	\$	33	42	0	0,00			
	07/2023	PLN		158	39	0	0,00			
	07/2023	THB		223	6	0	0,00			
	07/2023	\$	TRY	2	41	0	0,00			
	08/2023		PLN	39	158	0	0,00			
	08/2023		THB	6	223	0	0,00			
BRC	07/2023		PLN	37	158	1	0,00			
BSH	07/2023			0	0	0	0,00			
CBK	07/2023	£	\$	44	55	(1)	0,00			
	07/2023	INR		1	0	0	0,00			
	07/2023	MXN		255	15	0	0,00			
	07/2023	\$	MXN	12	213	1	0,00			
	08/2023			15	255	0	0,00			
GLM	07/2023		THB	6	223	0	0,00			
JPM	07/2023	€	\$	34	37	0	0,00			
	07/2023	£		212	269	(1)	0,00			
	07/2023	INR		1 731	21	0	0,00			
	07/2023	\$	INR	21	1 732	0	0,00			
	08/2023	INR	\$	1 734	21	0	0,00			
	08/2023	\$	€	37	34	0	0,00			
	08/2023		£	269	212	1	0,00			
MBC	07/2023		CNY	0	2	0	0,00			
	07/2023		£	290	234	8	0,01			
MYI	07/2023			323	260	7	0,00			
	07/2023		IDR	3	50 512	0	0,00			
	07/2023		ZAR	3	64	0	0,00			
	08/2023	IDR	\$	50 531	3	0	0,00			
	09/2023	\$	TRY	2	42	0	0,00			
SCX	07/2023		IDR	0	71	0	0,00			
	07/2023		MXN	2	42	0	0,00			
SOG	07/2023		€	37	34	1	0,00			
	07/2023	ZAR	\$	64	3	0	0,00			
	08/2023	\$	ZAR	3	64	0	0,00			
TOR	07/2023	£	\$	262	333	0	0,00			
	08/2023	\$	£	333	262	0	0,00			
UAG	07/2023	IDR	\$	50 320	3	0	0,00			
	07/2023	\$	CNY	31	219	(1)	0,00			
	07/2023		£	71	57	1	0,00			
	07/2023		TRY	3	77	0	0,00			
				\$	20	\$	(3)	\$	17	0,01

Total OTC Financial Derivative Instruments

\$ 3 678 1,60

DESCRIPTION

CERTIFICATS DE DÉPÔT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Banco Davivienda S.A. 13,501 % éch. 13/12/2024 15,389 % éch. 21/02/2024	COP 1 000 000 289 500	\$ 240 70	0,10 0,03
Bancolombia S.A. 5,917 % éch. 27/01/2024 13,320 % éch. 08/06/2025 13,637 % éch. 14/12/2024 16,137 % éch. 01/09/2024	 1 311 000 540 000 1 432 000 561 000	 302 130 345 136	0,13 0,06 0,15 0,06
BBVA Colombia S.A. 5,870 % éch. 15/07/2024 14,540 % éch. 13/01/2024	 1 187 000 543 100	 267 129	0,11 0,06
Total des Certificats de dépôt		\$ 1 619	0,70
Total des Investissements		\$ 228 545	99,12
Autres actifs et passifs à court terme		\$ 2 023	0,88
Actifs nets		\$ 230 568	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.

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 7 501 \$ (31 décembre 2022 : 4 974 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 2 161 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 201 556	\$ 4 083	\$ 205 639
Fonds d'investissement	12 618	0	0	12 618
Contrats de mise en pension	0	939	0	939
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(29)	7 759	0	7 730
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	501	1 118	1 619
Totaux	\$ 12 589	\$ 210 755	\$ 5 201	\$ 228 545

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ (17)	\$ 0	\$ (17)
BOA	(46)	600	554	(2 672)	2 460	(212)
BPS	520	(460)	60	(2 204)	1 480	(724)
BRC	2 030	(1 920)	110	(334)	510	176
CBK	(156)	0	(156)	(169)	10	(159)
CLY	S/O	S/O	S/O	(239)	0	(239)
DUB	(146)	0	(146)	653	(650)	3
FAR	81	0	81	S/O	S/O	S/O
GLM	763	(590)	173	(338)	440	102
GST	110	(360)	(250)	203	(260)	(57)
HUS	(12)	0	(12)	(8)	0	(8)
IND	(34)	80	(46)	(94)	340	246
JPM	(245)	210	(35)	224	0	224
MBC	711	(620)	91	847	(804)	43
MYC	61	0	61	84	0	84
MYI	(612)	551	(61)	(104)	281	177
RBC	598	(670)	(72)	(4)	0	(4)
SCX	(153)	260	107	922	(790)	132
SOG	(375)	460	85	86	0	86
SSB	274	(350)	(76)	630	(630)	0
TOR	(143)	0	(143)	151	0	151
UAG	452	(470)	(18)	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	64,86	54,96
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	24,33	32,75
Autres valeurs mobilières	S/O	0,83
Fonds d'investissement	5,47	7,21
Contrats de mise en pension	0,41	0,34
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,53)	0,34
Instruments financiers dérivés compensés	2,28	2,31
Instruments financiers dérivés hors cote	1,60	(1,04)
Certificats de dépôt	0,70	0,07

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Argentine	S/O	0,49
Bahamas	S/O	0,37
Biélorussie	S/O	0,08
Bésil	2,19	2,65
Îles Caïmans	0,45	0,70
Chili	3,66	S/O
Chine	0,00	0,02
Colombie	0,21	S/O
Congo	0,23	0,27
République tchèque	1,67	S/O
Danemark	0,24	2,08
République dominicaine	3,81	1,52
Ghana	S/O	0,48
Guatemala	0,39	S/O
Hongrie	1,21	S/O
Inde	0,21	S/O
Irlande	2,79	3,14
Israël	2,59	2,82
Côte d'Ivoire	0,37	0,45
Jersey, Îles Anglo-normandes	S/O	1,29
Luxembourg	0,04	1,19
Malaisie	1,66	S/O
Mexique	2,32	4,32
Pays-Bas	1,23	2,16
Panama	0,20	S/O
Paraguay	0,22	S/O
Pérou	4,58	3,18
Pologne	5,12	1,16
Roumanie	0,67	S/O
Russie	0,06	0,05
Serbie	0,05	0,05
Afrique du Sud	7,55	5,04
Corée du Sud	0,24	S/O
Supranationales	0,21	S/O
Suisse	0,19	S/O
Tunisie	0,09	0,09
Turquie	0,86	0,91
Émirats arabes unis	1,00	0,26
Royaume-Uni	1,34	1,36
États-Unis	21,46	20,18
Ouzbékistan	0,57	0,62
Îles Vierges britanniques	S/O	1,24
Zambie	0,38	S/O
Instruments à court terme	19,13	30,37
Fonds d'investissement	5,47	7,21
Contrats de mise en pension	0,41	0,34
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,53)	0,34
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,26	0,08
Swaps de taux d'intérêt	2,02	2,23
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	0,62	0,29
Options doubles (Straddle)	0,00	S/O
Options vendues		
Options de change	(0,13)	S/O
Swaptions de taux d'intérêt	S/O	(0,01)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,04	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,02)	(0,42)
Swaps sur devises croisées	0,03	0,04
Swaps de taux d'intérêt	0,04	0,12
Swaps de volatilité	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,66	(1,81)
Contrats de change à terme couverts	0,36	0,75
Certificats de dépôt	0,70	0,07
Autres actifs et passifs à court terme	0,88	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	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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				REPUBLIQUE DOMINICAINE				MALAISIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				ÉMISSIONS SOUVERAINES				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
AZÉRBÉIDJAN				Billets de la Banque centrale de République dominicaine				Obligation internationale du gouvernement malaisien			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				12,000 % éch. 03/10/2025 DOP 3 800 \$ 72 0,36				2,632 % éch. 15/04/2031 MYR 30 \$ 6 0,03			
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				10,000 % éch. 30/01/2026 3 200 63 0,31				3,800 % éch. 17/08/2023 5 400 1 158 5,77			
7,230 % éch. 17/03/2026 \$ 200 \$ 195 0,97				Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine				Émission d'investissement du gouvernement malaisien			
BRÉSIL				13,625 % éch. 03/02/2033 8 000 180 0,90				3,422 % éch. 30/09/2027 30 6 0,03			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				13,625 % éch. 10/02/2034 200 4 0,02				3,990 % éch. 15/10/2025 400 87 0,43			
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				Total République dominicaine 319 1,59				4,369 % éch. 31/10/2028 110 24 0,12			
0,000 % éch. 31/07/2023 (b)(e) 23 0 0,00				HONGRIE				Total Malaisie 1 281 6,38			
Oi S.A.				ÉMISSIONS SOUVERAINES				MEXIQUE			
0,000 % éch. 25/02/2035 BRL 50 9 0,05				Banque de développement hongroise				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				0,375 % éch. 09/06/2026 € 100 95 0,47				Petroleos Mexicanos			
9,850 % éch. 16/07/2032 2 502 478 2,38				6,500 % éch. 29/06/2028 \$ 200 198 0,99				10,000 % éch. 07/02/2033 \$ 50 46 0,23			
Vale S.A.				Obligation internationale du gouvernement hongrois				Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.			
0,000 % (e) 1 490 95 0,47				4,750 % éch. 24/11/2032 HUF 6 200 15 0,08				8,790 % éch. 09/12/2014 ^ MXN 5 000 0 0,00			
Total Brésil 582 2,90				5,000 % éch. 22/02/2027 € 50 55 0,27				46 0,23			
ILES CAÏMANS				6,750 % éch. 22/10/2028 HUF 4 200 12 0,06				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Hongrie 375 1,87				Obligation internationale du gouvernement mexicain			
Interoceanea Finance Ltd.				INDONÉSIE				5,000 % éch. 06/03/2025 1 800 97 0,48			
0,000 % éch. 30/11/2025 (b) \$ 14 13 0,07				ÉMISSIONS SOUVERAINES				7,000 % éch. 30/09/2026 4 900 267 1,33			
CHILI				Obligation internationale du gouvernement indonésien				7,500 % éch. 03/06/2027 4 700 260 1,30			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				7,500 % éch. 15/06/2035 IDR 65 000 5 0,02				7,750 % éch. 29/05/2031 2 300 127 0,63			
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos				IRLANDE				8,500 % éch. 31/05/2029 500 29 0,14			
5,000 % éch. 01/10/2028 CLP 30 000 37 0,18				TITRES ADRESSÉS À DES ACTIFS				Total Mexique 826 4,11			
6,000 % éch. 01/04/2033 55 000 72 0,36				Black Diamond CLO DAC				PAYS-BAS			
6,000 % éch. 01/01/2043 5 000 7 0,04				4,060 % éch. 20/01/2032 € 84 90 0,45				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Total Chili 116 0,58				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				Republic of Angola Via Avenir BV			
CHINE				4,073 % éch. 15/11/2031 100 107 0,53				10,163 % éch. 07/12/2023 \$ 5 5 0,03			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Harvest CLO DAC				PÉROU			
Flourish Century				4,250 % éch. 26/06/2030 89 95 0,47				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
6,600 % éch. 04/02/2022 ^ (h) \$ 200 22 0,11				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Banco de Credito del Peru S.A.			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				4,650 % éch. 17/09/2024 PEN 1 230 326 1,62			
Obligation internationale du gouvernement chinois				9,350 % éch. 06/08/2022 ^ RUB 33 000 11 0,06				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
3,020 % éch. 27/05/2031 CNY 600 85 0,42				Total Irlande 303 1,51				Fondo MIVIVIENDA S.A.			
Total Chine 107 0,53				ISRAËL				7,000 % éch. 14/02/2024 130 35 0,17			
COLOMBIE				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Obligation internationale du gouvernement péruvien			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Bank Leumi Le-Israel B.M.				7,300 % éch. 12/08/2033 400 114 0,57			
Empresas Publicas de Medellín ESP				7,129 % éch. 18/07/2033 (g) \$ 200 198 0,98				149 0,74			
7,625 % éch. 10/09/2024 COP 540 000 120 0,60				ÉMISSIONS SOUVERAINES				Total Pérou 475 2,36			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Obligation internationale du gouvernement israélien				POLOGNE			
Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter				0,150 % éch. 31/07/2023 ILS 400 108 0,54				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
7,875 % éch. 12/08/2024 12 000 3 0,01				1,500 % éch. 30/11/2023 500 133 0,66				Obligation internationale du gouvernement polonais			
Total Colombie 123 0,61				Total Israël 439 2,18				1,250 % éch. 25/10/2030 PLN 150 27 0,14			
REPUBLIQUE TCHÈQUE				JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				2,750 % éch. 25/10/2029 300 63 0,31			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				6,000 % éch. 25/10/2033 200 50 0,25			
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque				Corsair International Ltd.				7,500 % éch. 25/07/2028 300 80 0,40			
2,000 % éch. 13/10/2033 CZK 400 15 0,07				7,772 % éch. 28/01/2027 € 100 109 0,54				Total Pologne 220 1,10			
2,500 % éch. 25/08/2028 4 600 192 0,96				LUXEMBOURG				ROUMANIE			
Total République tchèque 207 1,03				ACTIONS				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
DANEMARK				DrillCo Holding Lux S.A. (a) 311 6 0,03				Obligation internationale du gouvernement roumain			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				DrillCo Holding Lux S.A. (a)(h) 787 15 0,08				4,250 % éch. 28/04/2036 RON 100 17 0,09			
Jyske Realkredit A/S				Total des Actions ordinaires 21 0,11				AFRIQUE DU SUD			
1,500 % éch. 01/10/2053 DKK 0 0 0,00				VALEUR NOMINALE (en milliers)				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Banque de développement de l'Afrique australe			
1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00				FORESEA Holding S.A.				8,600 % éch. 21/10/2024 (h) ZAR 3 200 167 0,83			
1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00				7,500 % éch. 15/06/2030 \$ 14 12 0,06				Eskom Holdings SOC Ltd.			
Nykredit Realkredit A/S				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				7,850 % éch. 02/04/2026 5 000 252 1,25			
1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00				5,250 % éch. 23/05/2023 ^ (g) 200 12 0,06				419 2,08			
1,000 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00				Total Luxembourg 45 0,23				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00								Obligation internationale du gouvernement sud-africain			
Realkredit Danmark A/S								2,000 % éch. 31/01/2025 (d) 2 615 134 0,67			
1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00								7,000 % éch. 28/02/2031 800 34 0,17			
1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00											
Total Danemark 0 0,00											

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency 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 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	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,750 %	15/03/2028	INR 5 600	\$ 1	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750	15/03/2028	SGD 40	0	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	\$ 1 450	51	0,25
À payer	CDI BRL à 1 an	6,140	04/01/2027	BRL 1 400	(34)	(0,16)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,325	04/01/2027	300	5	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	8,450	04/01/2027	300	(5)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,675	04/01/2027	1 700	(4)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	10,240	04/01/2027	400	(1)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,565	04/01/2027	1 300	3	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,244	02/01/2026	800	(3)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,405	02/01/2029	100	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,420	02/01/2026	900	4	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,708	02/01/2025	100	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,740	02/01/2025	200	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,750	02/01/2025	200	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)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,533	02/01/2029	400	(5)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,595	01/07/2024	1 200	1	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	12,684	02/01/2029	500	7	0,03
À payer	CDI BRL à 1 an	12,746	02/01/2029	500	7	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	13,080	01/07/2024	2 600	5	0,03
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,215	02/01/2025	200	(1)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,218	02/01/2029	1 000	(17)	(0,08)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	1,860	07/05/2025	CNY 1 700	(1)	(0,01)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	21/09/2027	2 770	(1)	(0,01)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	15/03/2028	790	0	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	15/03/2028	420	(1)	(0,01)
À payer ⁽¹⁾	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	20/09/2028	500	0	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,995	24/11/2025	COP 113 800	4	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,125	15/01/2026	386 000	13	0,06
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,975	23/06/2027	216 900	7	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,040	13/01/2031	1 002 000	50	0,24
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,200	18/09/2030	824 860	(14)	(0,07)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,175	28/05/2027	1 045 600	21	0,11
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,630	11/01/2027	1 088 400	14	0,07
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,080	02/02/2027	79 000	1	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,130	31/01/2027	81 000	1	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,140	01/02/2027	149 300	1	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,500	15/02/2025	112 850	1	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,585	14/02/2027	236 000	(1)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,890	08/04/2027	173 000	0	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,913	08/04/2027	266 200	1	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,940	08/04/2027	134 000	0	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,190	13/06/2029	494 700	4	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,200	11/03/2027	366 000	1	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,240	15/03/2027	101 600	0	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,305	28/04/2028	341 800	2	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,320	31/03/2027	203 000	1	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,390	13/06/2028	179 900	1	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,560	30/03/2027	58 200	0	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,686	30/03/2027	346 500	2	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,820	05/06/2028	314 400	(4)	(0,02)
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	431 000	(8)	(0,04)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,050	03/11/2027	3 357 000	34	0,17
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	9,177	26/11/2025	218 700	0	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,270	26/11/2025	243 000	(1)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,280	26/11/2025	610 000	(1)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,310	26/11/2025	473 000	(1)	(0,01)
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	9,430	16/06/2027	130 000	(2)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,470	01/07/2025	285 000	0	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,110	26/11/2025	274 280	(2)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,640	21/10/2025	817 000	(11)	(0,05)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,590	18/05/2028	ILS 200	0	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,665	15/03/2028	KRW 119 500	(1)	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2033	326 460	(3)	(0,01)
À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	15/03/2028	THB 4 520	1	0,01
À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,750	15/03/2033	50	0	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,375	20/10/2026	ZAR 2 740	14	0,07
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,067	21/12/2026	3 100	10	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	JIBAR ZAR à 3 mois	6,635 %	04/02/2027	ZAR 5 500	\$ 2	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,205	22/04/2027	1 200	3	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,210	22/04/2027	900	2	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,565	22/03/2026	2 900	3	0,02
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,500	17/10/2027	8 760	(2)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,830	23/02/2030	800	0	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	9,290	26/05/2028	2 500	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,080	01/06/2030	CLP 62 000	(13)	(0,07)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,110	01/06/2030	20 000	(4)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,120	05/02/2030	29 000	(4)	(0,02)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,215	14/01/2030	143 000	26	0,13
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,030	20/03/2033	189 200	4	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,180	01/10/2028	35 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,240	01/09/2030	37 210	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,370	01/10/2028	17 900	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,400	20/03/2028	155 400	(2)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,400	01/10/2028	35 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,420	01/10/2028	76 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,470	01/09/2030	50 000	(1)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,570	01/10/2028	70 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,890	17/03/2032	12 100	(2)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,930	17/03/2032	12 100	(2)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,010	16/02/2029	30 000	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,020	02/03/2029	2 900	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,110	01/09/2030	23 100	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,250	01/10/2028	4 600	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,370	29/06/2029	39 000	3	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,380	03/06/2027	116 000	5	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,420	24/03/2029	16 000	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,550	15/06/2032	16 000	3	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,610	17/06/2032	40 300	6	0,03
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	01/10/2028	11 600	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,195	01/10/2028	6 500	1	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,611	06/06/2028	CZK 4 700	(1)	(0,01)
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	€ 10	0	0,00
À payer ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	300	(4)	(0,02)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	7,840	07/02/2033	HUF 6 600	0	0,00
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	8,740	28/04/2028	14 400	(1)	0,00
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	13,600	12/12/2024	5 100	(1)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	0,980	09/06/2030	PLN 300	17	0,09
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	2,950	13/12/2026	1 500	21	0,10
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,075	07/03/2027	800	9	0,04
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,320	09/03/2027	150	1	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,220	20/03/2033	200	0	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,310	21/03/2033	200	(1)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,340	28/03/2027	100	0	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,430	16/03/2028	200	0	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,520	20/03/2026	500	0	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,620	21/03/2026	600	0	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,830	19/08/2024	3 000	(30)	(0,14)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	7,310	30/06/2027	500	7	0,04
À payer	TIE MXN à 28 jours	4,340	12/02/2024	MXN 22 060	(62)	(0,30)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	4,850	19/02/2025	3 700	18	0,09
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	4,463	18/05/2040	800	7	0,04
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	7,100	13/06/2031	3 590	15	0,08
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,950	20/02/2032	2 000	(1)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	8,050	24/02/2032	890	0	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	8,300	16/06/2028	600	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,414	14/12/2027	90	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,448	27/04/2028	400	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,457	27/04/2028	800	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,465	16/08/2027	400	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,515	17/12/2027	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,560	18/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,585	18/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,600	18/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,600	04/03/2033	1 300	(3)	(0,01)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,656	18/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,720	19/05/2028	200	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,722	19/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,728	22/05/2028	700	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,755	19/05/2028	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,900	21/05/2027	900	(1)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	9,060	18/06/2027	1 400	(1)	(0,01)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	9,090	08/07/2027	1 000	(1)	(0,01)
					\$ 163	0,81
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 163	0,81

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency 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
BOA	Option de vente - EUR contre CZK hors cote	CZK 23,830	01/11/2023	25	\$ 3	\$ 11	0,06
GLM	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF 385,000	01/11/2023	9	1	6	0,03
	Option de vente - EUR contre PLN hors cote	PLN 4,560	01/11/2023	19	2	15	0,07
JPM	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF 385,000	01/11/2023	19	2	12	0,06
MYI	Option de vente - USD contre BRL hors cote	BRL 4,820	22/08/2023	202	2	3	0,01
	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN 18,500	25/07/2023	221	6	16	0,08
RBC	Option de vente - USD contre CAD hors cote	CAD 1,305	13/07/2023	228	1	0	0,00
UAG	Option d'achat - EUR contre USD hors cote	\$ 1,140	13/07/2023	207	1	0	0,00
	Option d'achat - USD contre ZAR hors cote	ZAR 20,500	09/10/2023	363	5	4	0,02
					\$ 23	\$ 67	0,33

OPTIONS DOUBLES (STRADDLE)

Contrepartie	Description	Niveau d'exercice ⁽²⁾	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Coût ⁽²⁾	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600 %	27/12/2023	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	15,050	27/12/2023	100	0	0	0,00
CBK	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	15,100	20/12/2023	400	0	0	0,00
	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600	29/12/2023	100	0	0	0,00
MYI	Achat et vente - Contrat de volatilité à terme à 6 mois contre Contrat de volatilité à terme à 6 mois hors cote	12,600	27/12/2023	200	0	0	0,00
					\$ 0	\$ 0	0,00

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
JPM	Option d'achat - USD contre INR hors cote	IDR 14 950,000	06/06/2024	58	\$ (2)	\$ (0,01)	(0,01)
	Option de vente - USD contre INR hors cote	14 950,000	06/06/2024	58	(2)	(0,01)	(0,01)
MYI	Option d'achat - USD contre CLP hors cote	CLP 850,000	18/07/2023	129	(2)	0,00	0,00
	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN 17,750	25/07/2023	442	(3)	(0,07)	(0,07)
	Option d'achat - USD contre MXN hors cote	21,000	07/03/2024	211	(4)	(0,01)	(0,01)
					\$ (13)	\$ (0,10)	(0,10)

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

(2) Niveau d'exercice et coût final déterminés à une date future sur la base des paramètres implicites de volatilité.

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
BOA	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000) %	20/06/2024	\$ 100	\$ 6	\$ (4)	\$ 2	0,01
GST	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/06/2024	100	4	(2)	2	0,01
					\$ 10	\$ (6)	\$ 4	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
GST	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000 %	20/06/2024	\$ 100	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20/12/2024	100	(2)	1	(1)	0,00
					\$ (1)	\$ 1	\$ 0	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 DEVICES CROISEES

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)	\$ 163	\$ 162	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	58	58	0,29
						\$ (1)	\$ 221	\$ 220	1,10

SWAPS DE TAUX D'INTERET

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	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500 %	15/03/2028	MYR 200	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,545	05/05/2028	457	0	1	1	0,01
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,265	14/06/2029	CLP 11 100	0	(2)	(2)	(0,01)
JPM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	MYR 1 477	(1)	0	(1)	(0,01)
						\$ (1)	\$ (1)	\$ (2)	(0,01)

CONTRATS DE CHANGE A 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	07/2023	KES	4 674	\$ 33	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	PHP	997	18	0	0	0,00
	07/2023	PLN	462	111	0	(3)	(0,01)
	07/2023	\$	47	€ 43	0	0	0,00
	07/2023	699	MXN 12 862	49	0	49	0,25
	07/2023	5	PLN 19	0	0	0	0,00
	07/2023	22	TRY 478	0	(4)	(4)	(0,02)
	08/2023	CNY	183	\$ 26	1	1	0,00
	08/2023	INR	26 736	325	0	(1)	0,00
	08/2023	MXN	1 664	90	0	(6)	(0,03)
	08/2023	NZD	68	43	1	0	0,01
	08/2023	\$	300	CNY 2 059	0	(15)	(0,08)
	08/2023	7	EGP 249	0	0	0	0,00
	08/2023	22	TWD 672	0	0	0	0,00
	08/2023	ZAR	2 000	\$ 107	2	2	0,01
	09/2023	NGN	2 318	4	1	1	0,01
	09/2023	PEN	651	176	0	(3)	(0,01)
	09/2023	\$	14	HKD 109	0	0	0,00
	09/2023	420	KRW 531 998	0	(14)	(14)	(0,07)
	09/2023	101	MYR 463	0	(1)	(1)	(0,01)
	09/2023	402	TWD 12 206	0	(9)	(9)	(0,05)
	10/2023	4	KES 624	0	0	0	0,00
	10/2023	ZAR	965	\$ 52	1	1	0,01
	11/2023	€	156	CZK 3 819	3	3	0,02
BPS	07/2023	BRL	451	\$ 94	1	1	0,00
	07/2023	€	30	33	0	0	0,00
	07/2023	PHP	20 565	366	0	(6)	(0,03)
	07/2023	PLN	217	52	0	(1)	0,00
	07/2023	SGD	142	107	2	2	0,01
	07/2023	\$	56	BRL 282	2	2	0,01
	07/2023	61	COP 277 278	5	0	5	0,02
	07/2023	321	CZK 6 914	0	(4)	(4)	(0,02)
	07/2023	436	€ 398	0	(1)	(1)	(0,01)
	07/2023	22	£ 17	0	0	0	0,00
	07/2023	26	¥ 3 682	0	(1)	(1)	(0,01)
	07/2023	480	MYR 2 202	0	(7)	(7)	(0,03)
	07/2023	26	PHP 1 467	1	0	1	0,00
	07/2023	83	SGD 109	0	(2)	(2)	(0,01)
	08/2023	CNH	28	\$ 4	0	0	0,00
	08/2023	CNY	1 071	156	8	8	0,04
	08/2023	€	213	234	1	1	0,01
	08/2023	MYR	5 479	1 180	2	2	0,01
	08/2023	TWD	976	32	1	1	0,00
	08/2023	\$	354	CNY 2 421	0	(19)	(0,09)
	08/2023	43	COP 193 120	3	0	3	0,01
	08/2023	200	TWD 6 109	0	(4)	(4)	(0,02)
	08/2023	ZAR	974	\$ 53	2	2	0,01
	09/2023	CLP	25 348	31	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
	09/2023	PHP 5 657	\$ 101	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	(0,01)
	09/2023	THB 2	0	0	0	0	0,00
	09/2023	\$ 365	PHP 20 565	6	0	6	0,03
	09/2023	48	THB 1 658	0	(1)	(1)	0,00
	12/2023	NGN 810	\$ 1	0	0	0	0,00
	12/2023	\$ 70	MXN 1 242	1	0	1	0,00
	01/2024	ILS 6 236	\$ 1 753	58	0	58	0,29
	01/2024	ZAR 2 047	116	10	0	10	0,05
BRC	07/2023	CZK 91	4	0	0	0	0,00
	07/2023	MYR 189	41	1	0	1	0,00
	07/2023	PLN 122	29	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	RON 856	187	1	(2)	(1)	(0,01)
	07/2023	RSD 5 977	55	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 42	PLN 173	0	0	0	0,00
	07/2023	90	SGD 120	0	(2)	(2)	(0,01)
	08/2023	COP 2 752 653	\$ 646	0	(5)	(5)	(0,02)
	08/2023	ZAR 1 530	80	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	IDR 4 959	0	0	0	0	0,00
	09/2023	MXN 7 315	419	0	(1)	(1)	(0,01)
	09/2023	\$ 99	ILS 352	0	(3)	(3)	(0,02)
	09/2023	207	PEN 759	1	0	1	0,01
	10/2023	MXN 3 739	\$ 200	0	(14)	(14)	(0,07)
	10/2023	TRY 498	18	0	0	0	0,00
BSH	08/2023	PEN 61	15	0	(2)	(2)	(0,01)
CBK	07/2023	CLP 593 276	733	0	(6)	(6)	(0,03)
	07/2023	€ 231	248	0	(4)	(4)	(0,02)
	07/2023	PLN 1 113	266	0	(7)	(7)	(0,04)
	07/2023	TRY 4 990	222	32	0	32	0,16
	07/2023	\$ 65	BRL 310	0	0	0	0,00
	07/2023	84	COP 382 066	7	0	7	0,04
	07/2023	272	CZK 5 855	0	(3)	(3)	(0,01)
	07/2023	346	PHP 18 862	0	(5)	(5)	(0,02)
	07/2023	53	PLN 219	1	0	1	0,01
	07/2023	577	RON 2 609	0	(3)	(3)	(0,02)
	07/2023	35	UYU 1 325	0	0	0	0,00
	07/2023	UYU 2 928	\$ 76	0	(2)	(2)	(0,01)
	08/2023	BRL 454	88	0	(5)	(5)	(0,03)
	08/2023	CAD 20	15	0	0	0	0,00
	08/2023	COP 170 335	40	0	0	0	0,00
	08/2023	EGP 661	19	0	(2)	(2)	(0,01)
	08/2023	\$ 943	CLP 771 582	12	0	12	0,06
	08/2023	323	INR 26 736	2	0	2	0,01
	08/2023	9	NOK 89	0	0	0	0,00
	08/2023	60	PEN 236	4	0	4	0,02
	08/2023	208	TWD 6 360	0	(4)	(4)	(0,02)
	08/2023	30	ZAR 565	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	INR 26 736	\$ 323	0	(2)	(2)	(0,01)
	09/2023	KRW 5 215	4	0	0	0	0,00
	09/2023	MXN 2 471	133	0	(9)	(9)	(0,05)
	09/2023	PHP 5 715	101	0	(2)	(2)	(0,01)
	09/2023	\$ 704	IDR 10 510 877	0	(6)	(6)	(0,03)
	09/2023	220	INR 18 255	2	0	2	0,01
	09/2023	ZMW 159	\$ 9	0	0	0	0,00
	10/2023	CLP 5 926	7	0	0	0	0,00
	10/2023	\$ 5	NGN 2 985	0	(1)	(1)	(0,01)
	11/2023	ILS 492	149	16	0	16	0,08
	11/2023	\$ 86	EGP 2 763	0	(6)	(6)	(0,03)
	02/2024	EGP 325	\$ 9	0	0	0	0,00
	02/2024	\$ 31	EGP 1 071	0	(2)	(2)	(0,01)
DUB	07/2023	ILS 392	\$ 112	6	0	6	0,03
	07/2023	RON 188	42	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 626	BRL 3 394	78	0	78	0,38
	10/2023	14	NGN 8 028	0	(4)	(4)	(0,02)
	10/2023	1	ZAR 10	0	0	0	0,00
	11/2023	EGP 1 590	\$ 56	10	0	10	0,05
	01/2024	NGN 3 075	5	1	0	1	0,01
	01/2024	\$ 14	ZAR 285	0	0	0	0,00
	02/2024	128	EGP 4 495	0	(8)	(8)	(0,04)
GLM	07/2023	BRL 3 965	\$ 821	0	(1)	(1)	(0,01)
	07/2023	COP 67 560	16	0	0	0	0,00
	07/2023	DOP 909	16	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	EGP 973	31	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	RON 1 256	278	2	0	2	0,01
	07/2023	SGD 30	22	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 152	BRL 796	13	0	13	0,06
	07/2023	164	COP 694 514	2	0	2	0,01
	07/2023	65	CZK 1 393	0	(1)	(1)	(0,01)
	07/2023	29	EGP 953	2	0	2	0,01
	07/2023	275	MXN 4 837	7	0	7	0,03
	07/2023	3	PLN 11	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 277	RON 1 254	0	(1)	(1)	(0,01)
	08/2023	BRL 457	\$ 91	0	(3)	(3)	(0,01)
	08/2023	CNH 622	90	4	0	4	0,02
	08/2023	DOP 15 568	274	0	(6)	(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
	08/2023	\$ 149	DOP 8 574	\$ 5	0	\$ 5	0,02
	08/2023	4	NOK 40	0	0	0	0,00
	08/2023	ZAR 1 440	\$ 78	2	0	2	0,01
	09/2023	TRY 1 672	65	3	0	3	0,02
	09/2023	\$ 795	BRL 3 880	1	0	1	0,00
	09/2023	201	THB 6 923	0	(4)	(4)	(0,02)
	10/2023	DOP 5 562	\$ 99	1	0	1	0,00
	10/2023	NGN 14 944	27	8	0	8	0,04
	11/2023	EGP 1 593	56	10	0	10	0,05
	11/2023	€ 145	PLN 652	0	0	0	0,00
	11/2023	\$ 12	EGP 365	0	(2)	(2)	(0,01)
	12/2023	DOP 1 336	\$ 24	1	0	1	0,00
	01/2024	EGP 1 105	29	0	(1)	(1)	0,00
IND	08/2023	CNH 293	41	1	0	1	0,01
	08/2023	\$ 10	NOK 101	0	0	0	0,00
	11/2023	€ 21	HUF 9 727	5	0	5	0,02
	06/2024	\$ 82	TWD 2 110	0	(12)	(12)	(0,06)
JPM	07/2023	¥ 1 254	\$ 9	0	0	0	0,00
	07/2023	PLN 92	22	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	TRY 1 977	80	4	0	4	0,02
	07/2023	\$ 43	BRL 212	1	0	1	0,01
	07/2023	226	€ 211	5	0	5	0,02
	07/2023	74	MXN 1 295	2	0	2	0,01
	07/2023	4	NGN 2 156	0	(1)	(1)	(0,01)
	07/2023	23	PHP 1 234	0	0	0	0,00
	07/2023	1 688	SGD 2 230	0	(39)	(39)	(0,20)
	08/2023	CAD 32	\$ 24	0	0	0	0,00
	08/2023	CHF 3	3	0	0	0	0,00
	08/2023	CNH 23	3	0	0	0	0,00
	08/2023	CNY 682	96	1	0	1	0,01
	08/2023	COP 100 220	24	0	0	0	0,00
	08/2023	HUF 70 754	203	0	(2)	(2)	(0,01)
	08/2023	MXN 1 933	112	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 96	CNH 684	0	(2)	(2)	(0,01)
	08/2023	373	CNY 2 554	0	(20)	(20)	(0,10)
	08/2023	12	EGP 412	1	0	1	0,00
	08/2023	9	¥ 1 249	0	0	0	0,00
	08/2023	102	ZAR 1 994	3	0	3	0,02
	08/2023	ZAR 1 611	\$ 83	0	(2)	(2)	(0,01)
	09/2023	COP 63 315	15	0	0	0	0,00
	09/2023	PEN 594	161	0	(2)	(2)	(0,01)
	09/2023	\$ 95	ILS 338	0	(4)	(4)	(0,02)
	09/2023	32	INR 2 633	0	0	0	0,00
	09/2023	3	NGN 2 012	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	419	THB 14 363	0	(11)	(11)	(0,05)
	10/2023	MXN 1 584	\$ 90	0	0	0	0,00
	10/2023	\$ 7	NGN 4 093	0	(2)	(2)	(0,01)
	11/2023	HUF 9 736	€ 21	0	(5)	(5)	(0,02)
	12/2023	NGN 3 105	\$ 5	1	0	1	0,01
	12/2023	\$ 6	NGN 3 792	0	(1)	(1)	(0,01)
	01/2024	32	EGP 1 065	0	(3)	(3)	(0,02)
	02/2024	EGP 455	\$ 12	0	0	0	0,00
	04/2024	KES 7 223	47	0	(1)	(1)	0,00
	06/2024	\$ 8	IDR 120 000	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	€ 55	\$ 60	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	£ 103	127	0	(3)	(3)	(0,02)
	07/2023	PLN 8	2	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 76	COP 322 546	1	0	1	0,01
	08/2023	CNY 165	\$ 24	1	0	1	0,01
	08/2023	\$ 18	ZAR 353	0	0	0	0,00
	09/2023	40	INR 3 309	0	0	0	0,00
	09/2023	773	KRW 986 170	0	(22)	(22)	(0,11)
	01/2024	41	EGP 1 358	0	(4)	(4)	(0,02)
MYI	07/2023	CZK 2 186	\$ 101	1	0	1	0,00
	07/2023	MXN 396	22	0	(1)	(1)	(0,01)
	07/2023	MYR 63	14	0	0	0	0,00
	07/2023	PLN 407	97	0	(3)	(3)	(0,01)
	07/2023	\$ 199	COP 839 564	1	0	1	0,00
	07/2023	5	MYR 23	0	0	0	0,00
	07/2023	84	PLN 350	2	0	2	0,01
	08/2023	CHF 18	\$ 20	0	0	0	0,00
	08/2023	TWD 677	22	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 217	TWD 6 574	0	(6)	(6)	(0,03)
	08/2023	91	ZAR 1 773	2	0	2	0,01
	09/2023	TRY 878	\$ 33	0	0	0	0,00
	09/2023	\$ 128	IDR 1 912 383	0	(1)	(1)	(0,01)
	09/2023	866	KRW 1 108 296	0	(21)	(21)	(0,11)
	09/2023	191	THB 6 547	0	(5)	(5)	(0,03)
	10/2023	ZAR 19	\$ 1	0	0	0	0,00
	11/2023	EGP 210	6	0	0	0	0,00
	01/2024	654	18	0	0	0	0,00
	01/2024	NGN 3 075	5	1	0	1	0,01

- (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.
- (h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,99 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Banque de développement de l'Afrique australe 8,600 % éch. 21/10/2024	07/10/2021	\$ 215	\$ 167	0,83
DrillCo Holding Lux S.A.	08/06/2023	16	15	0,08
Flourish Century 6,600 % éch. 04/02/2022	25/08/2021	197	22	0,11
		\$ 428	\$ 204	1,02

Un montant en numéraire de 273 \$ (31 décembre 2022 : 282 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 17 095	\$ 258	\$ 17 353
Fonds d'investissement	1 960	0	0	1 960
Contrats de mise en pension	0	150	0	150
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	2	381	0	383
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	54	99	153
Totaux	\$ 1 962	\$ 17 680	\$ 357	\$ 19 999

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 15	\$ 0	\$ 15	\$ 95	\$ 0	\$ 95
BPS	56	0	56	(152)	0	(152)
BRC	(26)	0	(26)	21	0	21
BSH	(2)	0	(2)	S/O	S/O	S/O
CBK	6	0	6	98	0	98
CLY	S/O	S/O	S/O	(4)	0	(4)
DUB	84	0	84	13	0	13
GLM	280	(270)	10	404	(270)	134
GST	3	0	3	S/O	S/O	S/O
IND	(6)	0	(6)	(9)	0	(9)
JPM	(73)	0	(73)	49	0	49
MBC	(28)	0	(28)	(34)	0	(34)
MYC	S/O	S/O	S/O	(14)	0	(14)
MYI	(30)	0	(30)	25	0	25
RBC	(5)	0	(5)	1	0	1
RYL	(1)	0	(1)	S/O	S/O	S/O
SCX	(42)	0	(42)	124	0	124

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

30 juin 2023

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 61	\$ 0	\$ 61	\$ 38	\$ 0	\$ 38
SSB	51	0	51	S/O	S/O	S/O
TOR	(2)	0	(2)	(213)	0	(213)
UAG	(123)	0	(123)	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	69,29	27,93
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	17,00	44,26
Autres valeurs mobilières	0,11	0,70
Fonds d'investissement	9,76	9,83
Contrats de mise en pension	0,75	13,22
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,01	0,09
Instruments financiers dérivés compensés	0,81	1,99
Instruments financiers dérivés hors cote	1,09	2,67
Certificats de dépôt	0,76	0,37

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Argentine	S/O	0,22
Azerbaïdjan	0,97	0,93
Bésil	2,90	2,81
Îles Caïmans	0,07	0,21
Chili	0,58	0,03
Chine	0,53	0,11
Colombie	0,61	1,99
République tchèque	1,03	0,85
Danemark	0,00	1,89
République dominicaine	1,59	0,31
Hongrie	1,87	0,93
Indonésie	0,02	0,00
Irlande	1,51	1,52
Israël	2,18	2,07
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,54	0,51
Luxembourg	0,23	0,13
Malaisie	6,38	S/O
Île Maurice	S/O	0,87
Mexique	4,11	1,62
Pays-Bas	0,03	0,05
Pérou	2,36	1,60
Pologne	1,10	0,37
Roumanie	0,09	S/O
Qatar	S/O	0,45
Afrique du Sud	3,47	3,99
Royaume-Uni	0,62	1,48
États-Unis	5,44	5,71
Uruguay	0,32	S/O
Zambie	0,08	0,13
Instruments à court terme	47,77	42,11
Fonds d'investissement	9,76	9,83
Contrats de mise en pension	0,75	13,22
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,01	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 taux d'intérêt	0,81	1,99
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	0,33	0,13
Options doubles (Straddle)	0,00	S/O
Options vendues		
Options de change	(0,10)	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,02	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps sur devises croisées	1,10	1,01
Swaps de taux d'intérêt	(0,01)	0,00
Swaps de volatilité	S/O	0,00
Contrats de change à terme	(0,25)	1,53
Certificats de dépôt	0,76	0,37
Autres actifs et passifs à court terme	0,42	(1,06)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements

Fonds PIMCO ESG Income Fund

30 juin 2023

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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				
CREDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				CREDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				CREDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Wm Morrison Supermarkets Ltd.	8,073	751	0,29	Corporate Office Properties LP	100	76	0,03	JAB Holdings BV	200	222	0,09	
8,073 % éch. 04/11/2027				2,000 % éch. 15/01/2029				5,000 % éch. 12/06/2033				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				BANQUE ET FINANCE				BANQUE ET FINANCE				
ABN AMRO Bank NV	400	335	0,13	CPI Property Group S.A.	300	199	0,08	KBC Group NV	1 250	1 243	0,49	
2,470 % éch. 13/12/2029				1,750 % éch. 14/01/2030				5,796 % éch. 19/01/2029				
Acef Holding S.C.A.	100	89	0,03	2,750 % éch. 22/01/2028		255	0,10	Kilroy Realty LP	640	445	0,17	
0,750 % éch. 14/06/2028				Credit Agricole Assurances S.A.	200	166	0,07	2,500 % éch. 15/11/2032				
1,250 % éch. 26/04/2030		251	0,10	1,500 % éch. 06/10/2031				2,650 % éch. 15/11/2033		200	136	0,05
AIB Group PLC	400	396	0,16	Crown Castle, Inc.	550	480	0,19	Kookmin Bank	200	162	0,06	
2,875 % éch. 30/05/2031				3,100 % éch. 15/11/2029				2,500 % éch. 04/11/2030 (f)				
Ally Financial, Inc.	600	479	0,19	CTP NV	400	317	0,12	Lendlease Finance Ltd.	1 100	643	0,25	
2,200 % éch. 02/11/2028				1,250 % éch. 21/06/2029				3,400 % éch. 27/10/2027				
8,000 % éch. 01/11/2031		350	0,14	1,500 % éch. 27/09/2031		400	0,12	Logicor Financing SARL	500	363	0,14	
American Express Co.	500	477	0,19	Deutsche Bank AG	350	276	0,11	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	700	563	0,22	
4,050 % éch. 03/05/2029				3,035 % éch. 28/05/2032 (g)				2,494 % éch. 13/10/2032				
American Tower Corp.	200	131	0,05	3,742 % éch. 07/01/2033		500	0,14	5,475 % éch. 22/02/2031		800	796	0,31
3,100 % éch. 15/06/2050				6,720 % éch. 18/01/2029		500	0,20	Mizuho Financial Group, Inc.	800	641	0,25	
3,800 % éch. 15/08/2029		150	0,05	7,079 % éch. 10/02/2034		500	0,18	2,201 % éch. 10/07/2031				
Banque de développement asiatique	42 000	2 130	0,84	Digital Dutch Finco BV	600	596	0,23	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	400	402	0,16	
6,550 % éch. 26/01/2025				0,625 % éch. 15/07/2025				5,875 % éch. 23/05/2042				
Banco BTG Pactual S.A.	600	548	0,22	1,000 % éch. 15/01/2032		500	0,15	Nationstar Mortgage Holdings, Inc.	300	247	0,10	
2,750 % éch. 11/01/2026				EQT AB	600	467	0,18	5,750 % éch. 15/11/2031				
Banco de Sabadell S.A.	100	92	0,04	2,375 % éch. 06/04/2028		700	0,26	NE Property BV	200	161	0,06	
0,875 % éch. 16/06/2028				Equinix, Inc.	50	41	0,02	2,000 % éch. 20/01/2030				
Banco Mercantil del Norte S.A.	200	155	0,06	3,900 % éch. 15/04/2032		260	0,09	3,375 % éch. 14/07/2027		300	294	0,12
6,625 % éch. 24/01/2032 (e)(f)				Equitable Financial Life Global Funding	700	591	0,23	New Immo Holding S.A.	200	196	0,08	
Bancolombia S.A.	600	570	0,22	1,800 % éch. 08/03/2028				2,750 % éch. 26/11/2026				
3,000 % éch. 29/01/2025				First American Financial Corp.	600	457	0,18	Nexi SpA	259	258	0,10	
Bank Mandiri Persero Tbk PT	200	181	0,07	2,400 % éch. 15/08/2031				1,625 % éch. 30/04/2026				
2,000 % éch. 19/04/2026				Ford Motor Credit Co. LLC	200	193	0,08	Nomura Holdings, Inc.	600	507	0,20	
Bank of America Corp.	1 100	912	0,36	4,687 % éch. 09/06/2025		200	0,08	OneMain Finance Corp.	826	710	0,28	
2,687 % éch. 22/04/2032				5,584 % éch. 10/03/2024		200	0,08	PennyMac Financial Services, Inc.	200	163	0,06	
6,204 % éch. 10/11/2028		309	0,12	FS KKR Capital Corp.	450	367	0,14	5,750 % éch. 15/09/2031				
Bank of Ireland Group PLC	500	545	0,21	3,125 % éch. 12/10/2028				Protective Life Global Funding	800	628	0,25	
4,875 % éch. 16/07/2028				Globalworth Real Estate Investments Ltd.	400	329	0,13	1,737 % éch. 21/09/2030				
7,594 % éch. 06/12/2032		400	0,19	2,950 % éch. 29/07/2026				Rayonier LP	600	483	0,19	
Banque Ouest Africaine de Développement	470	374	0,15	Goldman Sachs Group, Inc.	800	641	0,25	2,750 % éch. 17/05/2031				
2,750 % éch. 22/01/2033				Goodman U.S. Finance Five LLC	700	644	0,25	Reinsurance Group of America, Inc.	200	201	0,08	
Barclays PLC	400	369	0,14	4,625 % éch. 04/05/2032				6,000 % éch. 15/09/2033				
4,836 % éch. 09/05/2028				Goodman U.S. Finance Three LLC	500	454	0,18	Rexford Industrial Realty LP	100	78	0,03	
5,501 % éch. 09/08/2028		500	0,19	3,700 % éch. 15/03/2028				2,150 % éch. 01/09/2031				
7,750 % éch. 15/09/2023 (e)(f)		200	0,08	GPT Wholesale Office Fund	400	207	0,08	Santander Holdings USA, Inc.	800	786	0,31	
BNP Paribas S.A.	400	353	0,14	3,222 % éch. 05/11/2031				5,807 % éch. 09/09/2026				
1,675 % éch. 30/06/2027				Grainger PLC	100	96	0,04	Santander UK Group Holdings PLC	200	180	0,07	
4,625 % éch. 25/02/2031 (e)(f)		200	0,06	3,000 % éch. 03/07/2030				3,823 % éch. 03/11/2028				
7,750 % éch. 16/08/2029 (e)(f)		800	0,30	Hanwha Life Insurance Co. Ltd.	300	269	0,11	6,534 % éch. 10/01/2029				
Boston Properties LP	400	302	0,12	3,379 % éch. 04/02/2032				Segro Capital SARL	250	229	0,09	
2,550 % éch. 01/04/2032				HAT Holdings LLC	610	547	0,21	1,875 % éch. 23/03/2030				
BPCE S.A.	300	262	0,10	3,375 % éch. 15/06/2026				Sirius Real Estate Ltd.	400	361	0,14	
2,045 % éch. 19/10/2027				3,750 % éch. 15/09/2030		230	0,07	1,125 % éch. 22/06/2026				
Brookfield Finance UK PLC	550	429	0,17	Host Hotels & Resorts LP	100	79	0,03	1,750 % éch. 24/11/2028				
2,340 % éch. 30/01/2032				2,900 % éch. 15/12/2031				SLM Corp.	900	779	0,31	
CaixaBank S.A.	200	149	0,06	3,375 % éch. 15/12/2029				3,125 % éch. 02/11/2026				
3,625 % éch. 14/09/2028 (e)(f)				3,500 % éch. 15/09/2030		240	0,08	Société Générale S.A.	200	159	0,06	
3,750 % éch. 07/09/2029		300	0,13	Howard Hughes Corp.	700	559	0,22	4,750 % éch. 26/05/2026 (e)(f)				
6,208 % éch. 18/01/2029		500	0,20	4,375 % éch. 01/02/2031				6,691 % éch. 10/01/2034		1 000	1 019	0,40
Castellum Helsinki Finance Holding Abp	300	224	0,09	HSBC Holdings PLC	200	180	0,07	Sofina S.A.	200	175	0,07	
0,875 % éch. 17/09/2029				3,973 % éch. 22/05/2030				1,000 % éch. 23/09/2028				
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan	500	399	0,16	4,583 % éch. 19/06/2029		500	0,18	Standard Chartered PLC	500	392	0,15	
European Core Fund	200	173	0,07	6,254 % éch. 09/03/2034		600	0,24	2,678 % éch. 29/06/2032				
12/10/2029				Hudson Pacific Properties LP	250	182	0,07	3,603 % éch. 12/01/2033 (g)				
Citigroup, Inc.	500	498	0,20	3,950 % éch. 01/11/2027				6,301 % éch. 09/01/2029				
2,976 % éch. 05/11/2030				5,950 % éch. 15/02/2028		150	0,05	SVB Financial Group	370	248	0,10	
5,746 % éch. 25/01/2026 (g)				ING Groep NV	300	309	0,12	4,570 % éch. 29/04/2033 ^				
Citycon Treasury BV	300	239	0,09	4,125 % éch. 24/08/2033				Svenska Handelsbanken AB	200	155	0,06	
1,625 % éch. 12/03/2028				4,250 % éch. 16/05/2031 (e)(f)		200	0,05	4,750 % éch. 01/03/2031 (e)(f)				
CNP Assurances	400	361	0,14	4,875 % éch. 16/05/2029 (e)(f)		700	0,21	UBS Group AG	200	141	0,06	
1,250 % éch. 27/01/2029				Banque internationale pour la reconstruction et le développement	10 950	10 888	4,27	4,375 % éch. 10/02/2031 (e)(f)				
Cooperative Rabobank UA	900	804	0,32	3,000 % éch. 27/09/2023				5,959 % éch. 12/01/2034				
1,004 % éch. 24/09/2026				Intesa Sanpaolo SpA	200	149	0,06	UniCredit SpA	300	255	0,10	
				4,198 % éch. 01/06/2032				5,459 % éch. 30/06/2035				
				5,017 % éch. 26/06/2024		200	0,08	VIA Outlets BV	500	439	0,17	
				6,625 % éch. 31/05/2033		600	0,29					
				6,625 % éch. 20/06/2033		500	0,20					

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
Vonovia SE 1,875 % éch. 28/06/2028 2,375 % éch. 25/03/2032	€ 200	\$ 186	0,07	Nemak S.A.B. de C.V. 2,250 % éch. 20/07/2028	€ 400	\$ 355	0,14	PacifiCorp 5,350 % éch. 01/12/2053	\$ 700	\$ 640	0,25
Weyerhaeuser Co. 7,375 % éch. 15/03/2032	\$ 85	95	0,04	Newell Brands, Inc. 4,875 % éch. 01/06/2025	\$ 200	193	0,08	Pattern Energy Operations LP 4,500 % éch. 15/08/2028	500	457	0,18
Workspace Group PLC 2,250 % éch. 11/03/2028	£ 500	466	0,18	NXP BV 2,500 % éch. 11/05/2031 5,000 % éch. 15/01/2033	250 1 000	204 961	0,08 0,38	Southern California Edison Co. 2,500 % éch. 01/06/2031 3,650 % éch. 01/06/2051	400 200	333 149	0,13 0,06
ZF Finance GmbH 2,000 % éch. 06/05/2027 2,250 % éch. 03/05/2028	€ 400 100	381 92	0,15 0,04	Pearson Funding PLC 3,750 % éch. 04/06/2030	£ 100	108	0,04	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % éch. 24/04/2033	324	319	0,13
		61 551	24,17	RELX Capital, Inc. 4,750 % éch. 20/05/2032	\$ 800	785	0,31	TDC Net A/S 5,056 % éch. 31/05/2028 5,618 % éch. 06/02/2030	€ 300 2 700	322 2 893	0,13 1,14
INDUSTRIE				ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027	200	187	0,07	TerraForm Power Operating LLC 5,000 % éch. 31/01/2028	\$ 230	212	0,08
Accor S.A. 2,375 % éch. 29/11/2028	900	884	0,35	S&P Global, Inc. 2,700 % éch. 01/03/2029	700	631	0,25	Verizon Communications, Inc. 2,850 % éch. 03/09/2041 5,050 % éch. 09/05/2033	300 1 500	214 1 484	0,08 0,58
Amgen, Inc. 5,600 % éch. 02/03/2043	\$ 900	903	0,35	Schaeffler AG 3,375 % éch. 12/10/2028	€ 200	200	0,08	Vodafone Group PLC 5,125 % éch. 04/06/2081	113	82	0,03
Arcadis NV 4,875 % éch. 28/02/2028	€ 200	218	0,09	SK Hynix, Inc. 6,375 % éch. 17/01/2028	\$ 600	603	0,24			13 577	5,33
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3,000 % éch. 01/09/2029	600	489	0,19	Standard Industries, Inc. 2,250 % éch. 21/11/2026	€ 600	583	0,23	Total des Obligations et billets privés		95 481	37,49
Ball Corp. 3,125 % éch. 15/09/2031	\$ 580	478	0,19	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % éch. 27/07/2029	300	263	0,10	AGENCES DU GOUVERNEMENT AMERICAIN			
BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % éch. 30/11/2028	€ 100	93	0,04	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 7,875 % éch. 15/09/2031	400	452	0,18	Fannie Mae 3,500 % éch. 01/08/2059 4,000 % éch. 01/11/2059	3 138 135	2 864 128	1,12 0,05
Boise Cascade Co. 4,875 % éch. 01/07/2030	\$ 380	344	0,13	Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 2,450 % éch. 16/03/2031	\$ 500	410	0,16	Ginnie Mae, TBA 5,000 % éch. 01/07/2053	2 500	2 457	0,97
CDW LLC 3,569 % éch. 01/12/2031	500	423	0,17	Travis Perkins PLC 3,750 % éch. 17/02/2026	£ 400	458	0,18	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 3,000 % éch. 01/07/2052 4,000 % éch. 01/05/2053 4,500 % éch. 01/07/2052 - 01/06/2053	492 1 541 2 599 21 763	433 1 446 2 501 21 696	0,17 0,57 0,98 8,52
Cellnex Finance Co. S.A. 3,875 % éch. 07/07/2041	200	147	0,06	VeriSign, Inc. 2,700 % éch. 15/06/2031	\$ 650	541	0,21	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 2,000 % éch. 01/08/2053 2,500 % éch. 01/07/2053 3,500 % éch. 01/08/2053 4,000 % éch. 01/07/2053 5,000 % éch. 01/08/2053 5,500 % éch. 01/07/2053 6,000 % éch. 01/08/2053 6,500 % éch. 01/07/2053	500 0 800 18 950 5 300 23 800 14 100 7 400 5 500	408 0 730 17 786 5 098 23 326 14 031 7 464 5 614	0,16 0,00 0,29 6,98 2,00 9,16 5,51 2,93 2,20
Centene Corp. 3,000 % éch. 15/10/2030	600	501	0,20	Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % éch. 26/03/2028	€ 300	257	0,10			105 982	41,61
Fair Isaac Corp. 4,000 % éch. 15/06/2028	610	560	0,22	Vmed 02 UK Financing PLC 4,500 % éch. 15/07/2031 4,750 % éch. 15/07/2031	£ 200 \$ 600	194 500	0,08 0,20	OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMERICAIN			
Flex Ltd. 6,000 % éch. 15/01/2028	300	305	0,12	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % éch. 03/12/2027	€ 400	379	0,15	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) 0,125 % éch. 15/07/2024 0,125 % éch. 15/10/2024 0,125 % éch. 15/07/2031 0,125 % éch. 15/01/2032 0,250 % éch. 15/01/2025 0,500 % éch. 15/04/2024 0,625 % éch. 15/01/2024 0,750 % éch. 15/02/2045 1,000 % éch. 15/02/2046 1,375 % éch. 15/02/2044	500 0 800 18 950 5 300 23 800 14 100 7 400 5 500	408 0 730 17 786 5 098 23 326 14 031 7 464 5 614	0,16 0,00 0,29 6,98 2,00 9,16 5,51 2,93 2,20
Ford Motor Co. 3,250 % éch. 12/02/2032	80	63	0,02	Weir Group PLC 2,200 % éch. 13/05/2026	\$ 400	358	0,14	Billets du Trésor américain 2,375 % éch. 31/03/2029 3,875 % éch. 30/09/2029	2 100 2 400	1 918 2 377	0,75 0,94
Forvia 2,750 % éch. 15/02/2027	€ 500	495	0,19	Zenith Finco PLC 6,500 % éch. 30/06/2027	£ 200	194	0,08			20 115	7,90
Gap, Inc. 3,625 % éch. 01/10/2029 3,875 % éch. 01/10/2031	\$ 200 300	142 206	0,06 0,08	ZF North America Capital, Inc. 6,875 % éch. 14/04/2028	\$ 150	152	0,06	TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
GN Store Nord A/S 0,875 % éch. 25/11/2024	€ 400	407	0,16			20 353	7,99	1211 Avenue of the Americas Trust 4,280 % éch. 10/08/2035	1 895	1 661	0,65
Graphic Packaging International LLC 2,625 % éch. 01/02/2029	400	385	0,15	SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				225 Liberty Street Trust 4,501 % éch. 10/02/2036	1 200	999	0,39
HCA, Inc. 4,500 % éch. 15/02/2027	\$ 500	483	0,19	AES Corp. 2,450 % éch. 15/01/2031 5,450 % éch. 01/06/2028	300 700	243 688	0,10 0,27	245 Park Avenue Trust 3,779 % éch. 05/06/2037	1 250	1 030	0,40
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % éch. 15/02/2032 4,000 % éch. 01/05/2031	380 200	317 174	0,12 0,07	CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % éch. 01/04/2053	800	819	0,32	280 Park Avenue Mortgage Trust 6,262 % éch. 15/09/2034	2 297	2 144	0,84
InterContinental Hotels Group PLC 3,375 % éch. 08/10/2028	£ 500	540	0,21	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. 4,250 % éch. 25/03/2027	186	163	0,06	Banc of America Funding Trust 6,479 % éch. 25/10/2036	63	54	0,02
JCDecaux SE 1,625 % éch. 07/02/2030	€ 300	269	0,10	Enel Finance America LLC 7,100 % éch. 14/10/2027	800	841	0,33	Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 0,749 % éch. 10/08/2033 (a)	9 200	105	0,04
JDE Peet's NV 2,250 % éch. 24/09/2031	\$ 600	465	0,18	Enel Finance International NV 1,375 % éch. 12/07/2026 2,250 % éch. 12/07/2031	300 400	265 314	0,10 0,12				
John Lewis PLC 6,125 % éch. 21/01/2025	£ 200	245	0,10	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % éch. 29/07/2026	200	188	0,07				
Lendlease Europe Finance PLC 3,500 % éch. 02/12/2033	164	136	0,05	Iberdrola International BV 6,750 % éch. 15/09/2033	250	265	0,10				
Lenovo Group Ltd. 3,421 % éch. 02/11/2030	\$ 400	337	0,13	India Green Energy Holdings 5,375 % éch. 29/04/2024	250	244	0,10				
Liberty Utilities Finance GP 2,050 % éch. 15/09/2030	300	233	0,09	India Green Power Holdings 4,000 % éch. 22/02/2027	250	219	0,09				
Lindblad Expeditions LLC 6,750 % éch. 15/02/2027	300	286	0,11	National Grid PLC 0,250 % éch. 01/09/2028	€ 400	362	0,14				
Marks & Spencer PLC 4,500 % éch. 10/07/2027	£ 350	394	0,15	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % éch. 15/06/2028 2,200 % éch. 02/12/2026	\$ 400 AUD 400	343 240	0,14 0,10				
Metalsa S.A. de C.V. 3,750 % éch. 04/05/2031	\$ 150	118	0,05	Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % éch. 01/04/2053	\$ 1 300	1 278	0,50				
MSCI, Inc. 3,625 % éch. 01/09/2030	400	345	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
4,216 % éch. 10/08/2033	\$ 105	\$ 92	0,04	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	\$ 87	\$ 75	0,03	Mosaic Solar Loans LLC	\$ 486	\$ 459	0,18
4,498 % éch. 10/08/2035	1 600	1 413	0,55	3,342 % éch. 25/11/2036 ^				4,450 % éch. 20/06/2042			
4,715 % éch. 10/08/2033	2 190	1 720	0,67	Worldwide Plaza Trust				Soundview Home Loan Trust			
5,122 % éch. 10/08/2035	550	451	0,18	3,715 % éch. 10/11/2036	1 795	1 173	0,46	5,650 % éch. 25/10/2036	591	552	0,22
Bear Stearns ALT-A Trust						35 041	13,76	Structured Asset Investment Loan Trust			
5,470 % éch. 25/06/2046 ^	790	682	0,27	TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				6,125 % éch. 25/05/2035	1 405	1 205	0,47
Bridgeway Funding PLC				Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
8,466 % éch. 16/10/2062	£ 950	1 196	0,47	6,200 % éch. 25/05/2035	1 275	1 148	0,45	5,440 % éch. 25/07/2036 ^	1 318	1 254	0,49
9,466 % éch. 16/10/2062	950	1 192	0,47	Argent Securities Trust				Structured Asset Securities Corp. Trust			
Commercial Mortgage Trust				5,450 % éch. 25/06/2036	2 021	604	0,24	6,888 % éch. 25/05/2031	72	57	0,02
3,960 % éch. 10/02/2036	\$ 3 000	2 612	1,03	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				5,650 % éch. 25/08/2036	1 287	1 160	0,46	6,150 % éch. 25/10/2034	1 051	1 032	0,41
5,297 % éch. 19/03/2037	1 290	1 089	0,43	6,275 % éch. 25/02/2035	61	60	0,02			17 041	6,69
EMF-UJK PLC				BNC Mortgage Loan Trust				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
5,970 % éch. 13/03/2046	£ 3 250	4 093	1,61	3,821 % éch. 25/10/2036	104	75	0,03	Obligation internationale du gouvernement chilien			
Great Hall Mortgages PLC				Centex Home Equity Loan Trust				2,750 % éch. 31/01/2027	300	279	0,11
5,282 % éch. 18/06/2038	2 040	2 514	0,99	6,065 % éch. 25/10/2035	41	41	0,02	3,500 % éch. 31/01/2034	300	265	0,11
Independence Plaza Trust				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				Fondo MIVIVIENDA S.A.			
3,763 % éch. 10/07/2035	\$ 345	322	0,13	5,290 % éch. 25/06/2047 ^	70	62	0,02	4,625 % éch. 12/04/2027	300	290	0,11
3,911 % éch. 10/07/2035	1 940	1 797	0,71	5,670 % éch. 25/12/2036 ^	305	286	0,11	Obligation internationale du gouvernement mexicain			
4,158 % éch. 10/07/2035	132	122	0,05	First Franklin Mortgage Loan Trust				2,250 % éch. 12/08/2036	€ 870	704	0,28
4,356 % éch. 10/07/2035	1 050	944	0,37	4,234 % éch. 25/03/2036	1 447	1 285	0,51	Obligation internationale du gouvernement roumain			
Madison Avenue Mortgage Trust				5,900 % éch. 25/12/2035	968	920	0,36	1,750 % éch. 13/07/2030	600	500	0,20
3,478 % éch. 15/08/2034	690	588	0,23	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust				Obligation internationale du gouvernement serbe			
3,600 % éch. 15/08/2034	225	185	0,07	5,520 % éch. 22/02/2055	677	646	0,25	1,000 % éch. 23/09/2028	400	339	0,13
4,108 % éch. 15/08/2034	1 900	1 510	0,59	GSAMP Trust				Obligation internationale du gouvernement sud-africain			
MortgageIT Trust				5,830 % éch. 25/06/2036	1 837	979	0,38	10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 8 000	440	0,17
5,750 % éch. 25/08/2035	358	341	0,13	6,050 % éch. 25/11/2035 ^	100	94	0,04			2 817	1,11
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				INSTRUMENTS À COURT TERME			
3,917 % éch. 15/11/2032	1 220	1 016	0,40	4,459 % éch. 25/01/2037	4 250	2 327	0,91	BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				Lehman XS Trust				5,405 % éch.			
5,530 % éch. 25/12/2036	75	66	0,03	5,470 % éch. 25/02/2037	598	577	0,23	26/09/2023 (b)(c)(h)	\$ 40 000	39 494	15,50
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				Long Beach Mortgage Loan Trust				Total des Instruments à court terme		39 494	15,50
4,573 % éch. 25/04/2037	43	34	0,01	5,450 % éch. 25/11/2036	516	372	0,15	Total des Valeurs mobilières	\$ 316 722	124,35	
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				5,460 % éch. 25/08/2036	2 555	1 382	0,54				
5,795 % éch. 25/04/2035	49	46	0,02	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust							
Towd Point Mortgage Funding PLC				5,825 % éch. 25/09/2035	500	464	0,18				
5,161 % éch. 20/10/2051	£ 3 000	3 775	1,48								

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	5,100 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 20 900	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2030	\$ (21 377)	\$ 20 900	\$ 20 909	8,21
	5,160	30/06/2023	03/07/2023	3 300	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031	(3 383)	3 300	3 301	1,30
	5,180	30/06/2023	03/07/2023	7 600	Billets du Trésor américain 0,375 % éch. 30/04/2025	(7 755)	7 600	7 603	2,98
Total des Contrats de mise en pension						\$ (32 515)	\$ 31 800	\$ 31 813	12,49

(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	5	\$ 33	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2025	3	13	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2026	4	13	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	4	23	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2025	2	7	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2024	4	26	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2025	2	8	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2026	3	9	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2024	3	15	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2025	3	10	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Long	09/2023	2	(3)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	10	22	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	52	109	0,04

Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income 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 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	10	\$ 12	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	1	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	14	(28)	(0,01)
				\$ 269	0,11

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	5	\$ (2)	\$ (2)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	5	(2)	0	0,00
Option de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	123,000	21/07/2023	1	0	0	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	131,000	21/07/2023	1	(1)	0	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,000	15/09/2023	6	(10)	0	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,063 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,063	15/12/2023	7	(14)	(1)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,125 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,125	15/12/2023	6	(11)	(1)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,188 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,188	15/09/2023	9	(17)	(1)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,375 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,375	15/12/2023	9	(19)	(2)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	98,000	15/12/2023	3	(2)	0	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,000	15/09/2023	6	(11)	(21)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,063 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,063	15/12/2023	7	(14)	(26)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,125 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,125	15/12/2023	6	(12)	(23)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,188 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,188	15/09/2023	9	(18)	(36)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,375 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,375	15/12/2023	9	(19)	(40)	(0,02)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	3	(3)	(14)	(0,01)
				\$ (155)	\$ (167)	(0,07)
				\$ 102	0,04	

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 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	\$ 0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2028	900	2	0,00
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	100	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 recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500 %	20/09/2033	£ 1 500	\$ 108	0,04
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2026	¥ 330 000	3	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2028	890 000	67	0,03
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2028	1 690 000	(200)	(0,08)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	330 000	22	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2042	170 000	39	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/07/2023	\$ 500	7	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	18/07/2023	500	7	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/08/2023	8 800	121	0,05
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	06/09/2023	500	7	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2028	150	16	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	16/06/2031	100	13	0,01
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2026	6 000	(610)	(0,24)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/06/2051	40	8	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,270	04/11/2023	8 800	(145)	(0,06)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,350	20/01/2027	200	20	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,360	15/02/2027	550	54	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,380	04/01/2027	500	(52)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,418	20/01/2027	250	(24)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,420	24/02/2027	400	38	0,01
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,425	18/01/2027	500	(47)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,443	18/01/2027	500	(50)	(0,02)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,450	17/02/2027	500	47	0,02
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,450	16/07/2031	50	9	0,00
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/12/2028	800	(104)	(0,04)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	12/01/2029	110	14	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 ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,518 %	20/01/2029	\$ 150	\$ (19)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,535	15/10/2031	200	(32)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,550	20/01/2027	700	(63)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,570	11/01/2027	200	(18)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,570	12/01/2027	100	(9)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,573	28/02/2027	300	(29)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,580	16/02/2027	300	(26)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,600	16/01/2026	2 700	99	0,04
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,600	15/02/2027	2 200	(191)	(0,08)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,618	09/02/2029	200	(24)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,620	18/04/2027	300	(27)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630	26/01/2029	150	(18)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,650	24/02/2027	1 300	(110)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,650	08/02/2032	250	(38)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,655	24/01/2032	150	(23)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	06/03/2024	500	(12)	0,00
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	17/02/2027	2 100	(174)	(0,07)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	12/01/2029	400	(45)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,730	24/02/2032	150	(22)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,735	12/01/2032	150	(23)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,765	16/03/2032	300	(42)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,770	14/02/2032	150	(21)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,783	22/04/2027	400	(34)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,785	12/08/2051	50	16	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,788	03/05/2027	500	(42)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,815	24/01/2052	50	(15)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,817	05/04/2032	150	(20)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,867	26/01/2052	50	(14)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,872	06/04/2032	150	(20)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,888	22/03/2029	200	(21)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,928	25/03/2027	300	(25)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2027	2 820	70	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2029	2 600	56	0,02
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	18/02/2032	200	(25)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	9 850	(316)	(0,12)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	15/12/2051	200	(62)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,250	17/06/2027	400	(25)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,300	17/01/2026	2 000	73	0,03
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,350	17/01/2025	3 500	82	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,370	21/06/2027	400	(24)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,430	30/09/2027	460	36	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	6 800	161	0,06
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,450	04/10/2027	460	35	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,605	28/06/2027	400	(20)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	3 200	159	0,06
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,850	30/08/2027	1 000	(52)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,880	30/09/2027	1 300	(64)	(0,03)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,900	04/10/2027	1 300	(63)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,955	04/10/2027	300	(14)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2030	1 570	23	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	40	(2)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	07/09/2027	600	(26)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	600	(26)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	06/09/2032	500	(22)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	600	(24)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	4 810	(142)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,300	06/03/2033	200	(5)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,340	23/02/2030	400	(10)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,350	14/12/2032	100	3	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,370	01/03/2033	200	(3)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,400	23/02/2033	200	(3)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,405	01/03/2033	300	(4)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,420	24/05/2033	300	(3)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,425	01/03/2033	300	(4)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,430	27/02/2033	300	(4)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,450	07/03/2033	500	(5)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	400	(7)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/06/2030	600	(5)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/05/2033	21 620	(62)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	21/06/2033	400	0	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	200	(3)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,610	12/12/2032	200	2	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,700	06/06/2033	12 640	(31)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	21/06/2025	10 300	199	0,08
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	13/12/2027	400	7	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,040	20/06/2024	1 500	(11)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,060	20/06/2024	6 000	(44)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,140	22/06/2024	2 500	(16)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,500	22/05/2025	47 760	(202)	(0,08)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,900	06/06/2025	27 590	(13)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	5,100	22/05/2024	92 690	(101)	(0,04)

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	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	5,400 %	06/06/2024	\$ 53 540	\$ 47	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/07/2023	500	(7)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	18/07/2023	500	(7)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/08/2023	8 800	(121)	(0,05)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	06/09/2023	500	(7)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/09/2023	150	2	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/09/2023	100	1	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/09/2023	6 000	(66)	(0,03)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/09/2023	40	0	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,350	20/07/2023	200	1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	15/08/2023	550	4	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,418	20/07/2023	250	(2)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,420	24/08/2023	400	3	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,425	18/07/2023	500	(3)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	16/07/2023	50	0	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	17/08/2023	500	3	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	12/07/2023	110	1	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/09/2023	800	(8)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/07/2023	150	(1)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	15/07/2023	200	(2)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,550	20/07/2023	700	(4)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	11/07/2023	200	(1)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	12/07/2023	100	(1)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,580	16/08/2023	300	(2)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,600	15/08/2023	2 200	(12)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/07/2023	150	(1)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,650	24/08/2023	1 300	(7)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,655	24/07/2023	150	(1)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	12/07/2023	400	(2)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	17/08/2023	2 100	(11)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,735	12/07/2023	150	(1)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,785	12/08/2023	50	0	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,815	24/07/2023	50	0	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,867	26/07/2023	50	0	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	18/08/2023	200	(1)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/09/2023	200	(2)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	€ 700	(66)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	400	(37)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	11/04/2024	400	(6)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	13/04/2024	800	(13)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	17/05/2024	500	(8)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	400	(6)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	400	(6)	0,00
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	300	(7)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	400	(9)	0,00
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	13 500	72	0,03
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	6 300	(56)	(0,02)
					\$ (2 561)	(1,00)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (2 559)	(1,00)

(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.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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	\$ 24	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	60	0,02
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,053	20/07/2023	2 600	16	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,053	20/07/2023	2 600	16	57	0,02
	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	19	4	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	40	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	200	26	17	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	33	0,01
							\$ 204	\$ 235	0,09

Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉ

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 plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 1 an	0,030 %	24/07/2024	2 600	\$ (19)	\$ (57)	(0,02)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 1 an	0,030	24/07/2024	2 600	(19)	(1)	0,00
	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 1 an	0,026	23/07/2025	2 600	(23)	(42)	(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	2 600	(23)	(6)	0,00
						\$ (84)	\$ (106)	(0,04)

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

(2) L'instrument sous-jacent a une date d'entrée en vigueur différée.

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)	\$ 9	\$ (35)	(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
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500 %	16/12/2072	\$ 1 600	\$ (39)	\$ 6	\$ (33)	(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	08/2023	€	184	\$ 202	\$ 1	\$ 0	0,00
	08/2023	£	566	704	0	(16)	(0,01)
	08/2023	\$	3 667	AUD 5 425	0	(52)	(0,02)
	08/2023		911	NZD 1 436	0	(31)	(0,01)
	09/2023		555	KRW 702 848	0	(19)	(0,01)
BPS	08/2023		215	€ 198	2	0	0,00
	08/2023		1 685	MXN 29 340	12	0	0,00
	08/2023		28	ZAR 519	0	(1)	0,00
	10/2023		189	3 508	0	(5)	0,00
BRC	08/2023	£	1 897	\$ 2 380	0	(31)	(0,01)
	08/2023	\$	246	€ 225	0	0	0,00
	08/2023		1 339	£ 1 052	0	(1)	0,00
	08/2023		1 377	¥ 182 175	0	(108)	(0,04)
CBK	08/2023		34	ZAR 628	0	(1)	0,00
	07/2023		934	CLP 756 223	7	0	0,00
	07/2023		617	MXN 11 866	74	0	0,03
	08/2023	€	168	\$ 181	0	(3)	0,00
	08/2023	£	21	26	0	(1)	0,00
	08/2023	\$	596	CAD 795	5	0	0,00
	08/2023		262	CLP 214 438	3	0	0,00
	08/2023		290	€ 266	1	0	0,00
	08/2023		360	¥ 49 600	0	(14)	(0,01)
GLM	08/2023		433	NOK 4 521	0	(11)	0,00
	09/2023	KRW	6 890	\$ 5	0	0	0,00
	08/2023	\$	542	NOK 5 747	0	(4)	0,00
	08/2023		334	ZAR 6 198	0	(7)	0,00
	10/2023		537	10 073	0	(9)	0,00
JPM	07/2023		221	MXN 3 894	5	0	0,00
	08/2023	£	6 680	\$ 8 461	0	(34)	(0,01)
	08/2023	\$	977	CAD 1 306	11	0	0,00
	08/2023		225	¥ 29 939	0	(17)	(0,01)
	08/2023		200	NOK 2 119	0	(2)	0,00
	09/2023	IDR	1 304	\$ 0	0	0	0,00
MBC	10/2023	MXN	93	5	0	0	0,00
	08/2023	€	21 061	23 240	216	0	0,08
MYI	09/2023	\$	1 022	KRW 1 302 876	0	(29)	(0,01)
	07/2023	€	243	\$ 264	0	0	0,00
	07/2023	IDR	11 190	1	0	0	0,00
	07/2023	\$	53	€ 49	0	0	0,00
	07/2023		1	£ 1	0	0	0,00
	07/2023		1	IDR 11 190	0	0	0,00
	08/2023	€	295	\$ 319	0	(3)	0,00
	08/2023	\$	2 946	¥ 391 468	0	(221)	(0,09)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net	
	09/2023	KRW	3 450 069	\$ 2 642	\$ 12	\$ 12	0,01	
	09/2023	\$	1	IDR 11 200	0	0	0,00	
	09/2023		1 144	KRW 1 464 222	0	(28)	(0,01)	
SCX	08/2023	NZD	1 947	\$ 1 183	0	(9)	0,00	
	08/2023	\$	475	AUD 713	0	0	0,00	
	08/2023		318	NZD 510	0	(6)	0,00	
	09/2023	IDR	1 290 990	\$ 87	1	1	0,00	
SSB	07/2023	CLP	757 307		0	0	0,00	
	08/2023	\$	943	CLP 759 494	0	0	0,00	
UAG	08/2023	£	5 851	\$ 7 396	0	(45)	(0,02)	
					\$ 350	\$ (708)	\$ (358)	(0,14)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	5 523	\$ 3 665	\$ 0	\$ (11)	(0,01)	
	07/2023	\$	7 045	AUD 10 764	121	0	0,05	
	08/2023		3 668	5 523	11	0	0,00	
BOA	07/2023		21 626	33 284	529	0	0,21	
BPS	07/2023	AUD	30 669	\$ 20 313	4	(106)	(0,04)	
	07/2023	\$	902	AUD 1 390	24	0	0,01	
	08/2023		18 996	28 656	94	0	0,04	
CBK	07/2023		4 489	6 880	91	0	0,04	
JPM	07/2023		6 834	10 453	124	0	0,05	
SCX	07/2023	AUD	9 743	\$ 6 468	0	(18)	(0,01)	
	07/2023	\$	5 471	AUD 8 373	102	0	0,04	
	08/2023		6 473	9 743	18	0	0,01	
SOG	07/2023		10 804	16 514	188	0	0,07	
UAG	07/2023	AUD	32 947	\$ 21 876	42	(97)	(0,02)	
	07/2023	\$	8 383	AUD 12 805	141	0	0,05	
	08/2023		21 893	32 947	97	(42)	0,02	
					\$ 1 586	\$ (274)	\$ 1 312	0,51

Au 30 juin 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	
BPS	07/2023	CHF	759	\$ 849	\$ 0	\$ 0	0,00	
	07/2023	\$	1 141	CHF 1 033	13	0	0,01	
	08/2023		849	757	0	0	0,00	
MYI	07/2023	CHF	37	\$ 40	0	(1)	0,00	
SCX	07/2023	\$	815	CHF 733	4	0	0,00	
UAG	07/2023	CHF	783	\$ 873	0	(2)	0,00	
	07/2023	\$	735	CHF 660	3	0	0,00	
	08/2023		873	781	2	0	0,00	
					\$ 22	\$ (3)	\$ 19	0,01

Au 30 juin 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	
BOA	07/2023	€	3 145	\$ 3 437	\$ 6	\$ 6	0,00	
	07/2023	\$	35 959	€ 33 459	544	0	0,21	
BPS	07/2023	€	32 814	\$ 35 952	153	0	0,06	
	07/2023	\$	36 016	€ 33 502	534	0	0,21	
	08/2023		35 440	32 300	0	(152)	(0,06)	
CBK	07/2023	€	33 469	\$ 36 376	0	(138)	(0,05)	
	08/2023	\$	35 306	€ 32 428	122	0	0,05	
MBC	07/2023	€	477	\$ 512	0	(9)	0,00	
	07/2023	\$	163	€ 151	2	0	0,00	
SCX	07/2023		1 479	1 382	29	0	0,01	
SOG	07/2023		35 969	33 437	510	0	0,20	
					\$ 1 900	\$ (299)	\$ 1 601	0,63

Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 167	£ 135	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,01
BRC	07/2023	23	19	1	0	1	0,00
CBK	07/2023	7	5	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	167	135	4	0	4	0,00
MYI	07/2023	166	134	4	0	4	0,00
RYL	07/2023	£ 27	\$ 34	0	0	0	0,00
				\$ 13	\$ 0	\$ 13	0,01

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 2 838	NOK 31 475	\$ 100	\$ (1)	\$ 99	0,04
CBK	07/2023	NOK 194	\$ 18	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 1 505	NOK 16 919	75	0	75	0,03
GLM	07/2023	NOK 24 766	\$ 2 298	0	(14)	(14)	(0,01)
	07/2023	\$ 663	NOK 7 114	1	0	1	0,00
	08/2023	2 298	24 742	14	0	14	0,01
RYL	07/2023	2 689	28 856	20	(16)	4	0,00
SCX	07/2023	544	5 938	10	0	10	0,00
				\$ 220	\$ (32)	\$ 188	0,07

Au 30 juin 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	07/2023	SEK 82 108	\$ 7 607	\$ 7	\$ (1)	\$ 6	0,00
	07/2023	\$ 114	SEK 1 226	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	7 321	78 907	0	(6)	(6)	0,00
CBK	07/2023	5 146	56 206	58	0	58	0,02
GLM	07/2023	SEK 47	\$ 4	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 7	SEK 78	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	SEK 30	\$ 3	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 4 948	SEK 53 287	0	(15)	(15)	(0,01)
MYI	07/2023	SEK 79 039	\$ 7 321	3	0	3	0,00
	07/2023	\$ 7 091	SEK 76 120	0	(44)	(44)	(0,01)
	08/2023	7 321	78 941	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07/2023	SEK 13	\$ 1	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 4 943	SEK 53 471	7	0	7	0,00
				\$ 75	\$ (70)	\$ 5	0,00

Au 30 juin 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
BRC	07/2023	\$ 93	SGD 126	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	07/2023	SGD 5	\$ 4	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	\$ 85	SGD 115	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	SGD 120	\$ 89	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 89	SGD 120	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	14	19	0	0	0	0,00
UAG	07/2023	92	124	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 2 658 1,04

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. 01/08/2053	\$ 500	\$ (441)	(0,17)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (441)	(0,17)
Total des Investissements		\$ 348 282	136,75
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (93 590)	(36,75)
Actifs nets		\$ 254 692	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) Titre convertible conditionnel.
 (g) 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.	5,746 %	25/01/2026	19/07/2022	\$ 488	\$ 498	0,20
Deutsche Bank AG	3,035	28/05/2032	25/08/2021 - 02/09/2021	359	276	0,11
Standard Chartered PLC	3,603	12/01/2033	05/01/2022	200	160	0,06
				\$ 1 047	\$ 934	0,37

(h) Un titre d'une juste valeur globale de 81 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 183 \$ (31 décembre 2022 : 810 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 3 324 \$ (31 décembre 2022 : 1 927 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 316 722	\$ 0	\$ 316 722
Contrats de mise en pension	0	31 800	0	31 800
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(3)	204	0	201
Titres vendus à découvert	0	(441)	0	(441)
Totaux	\$ (3)	\$ 348 285	\$ 0	\$ 348 282

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 121	\$ (300)	\$ (179)	\$ 4	\$ 0	\$ 4
BOA	1 050	(810)	240	43	0	43
BPS	576	(710)	(134)	(571)	550	(21)
BRC	(141)	134	(7)	59	0	59
CBK	266	(280)	(14)	1 021	(950)	71
DUB	(11)	0	(11)	(9)	0	(9)
GLM	(41)	0	(41)	3	260	263
JPM	86	(280)	(194)	187	0	187
MBC	169	(300)	(131)	660	(350)	310
MYC	(75)	0	(75)	(69)	0	(69)
MYI	(281)	130	(151)	263	(20)	243
RYL	4	0	4	88	0	88
SAL	S/O	S/O	S/O	(6)	0	(6)
SCX	138	(290)	(152)	799	(780)	19
SOG	698	(700)	(2)	S/O	S/O	S/O
UAG	99	(270)	(171)	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	73,15	36,58
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	51,20	69,50
Autres valeurs mobilières	S/O	0,71
Contrats de mise en pension	12,49	18,66
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,04	0,05
Instruments financiers dérivés compensés	(1,00)	(0,62)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,04	1,11
Titres vendus à découvert	(0,17)	(1,11)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,29	0,52
Obligations et billets privés	37,49	34,38
Agences du gouvernement américain	41,61	29,05
Obligations du Trésor américain	7,90	5,52
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	13,76	12,90
Titres adossés à des actifs	6,69	6,03
Émissions souveraines	1,11	1,19
Instruments à court terme	15,50	17,20
Contrats de mise en pension	12,49	18,66
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,11	0,05
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,07)	0,00
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	(0,01)
Swaps de taux d'intérêt	(1,00)	(0,61)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,09	0,08
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,07)	(0,10)
Options à taux d'intérêt plafonné	(0,04)	(0,04)
Options sur titres	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,02)	(0,02)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	(0,01)	(0,01)
Contrats de change à terme	(0,14)	(0,10)
Contrats de change à terme couverts	1,23	1,30
Titres vendus à découvert	(0,17)	(1,11)
Autres actifs et passifs à court terme	(36,75)	(24,88)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF (en milliers)	NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF (en milliers)	NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF (en milliers)	NET					
TITRES ADOSÉS A DES CRÉANCES HYPOTHECAIRES NON EMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				5,172 % éch. 18/06/2038	£	34	40	0,00	5,841 % éch. 20/07/2045	£	6 552	€	7 615	0,43		
Adjustable Rate Mortgage Trust				5,644 % éch. 18/06/2039		38	35	0,00	6,097 % éch. 20/05/2045		7 112		8 264	0,47		
3,285 % éch. 25/01/2036 ^	\$	5	4	0,00				6,546 % éch. 20/02/2054		1 905			2 221	0,13		
Alba PLC				GSR Mortgage Loan Trust	\$	4	3	0,00	Tower Bridge Funding PLC		4 968		5 758	0,33		
5,075 % éch. 25/11/2042	£	244	277	0,02	HarborView Mortgage Loan Trust		3	2	0,00	5,527 % éch. 20/11/2063						
5,171 % éch. 15/12/2038		3 112	3 471	0,20	4,424 % éch. 19/05/2033				Trinity Square PLC		6 436		7 489	0,43		
American Home Mortgage Investment Trust				Harbour	£	4 399	5 106	0,29	5,316 % éch. 15/07/2059							
6,500 % éch. 25/03/2047	\$	406	277	0,02	5,358 % éch. 28/01/2054				Tudor Rose Mortgages		2 614		3 029	0,17		
Atlas Funding PLC				Hops Hill PLC		5 200	6 036	0,34	5,509 % éch. 20/06/2048							
5,937 % éch. 20/01/2061	£	1 683	1 963	0,11	0,000 % éch. 21/12/2055		3 198	3 751	0,21	Twin Bridges PLC		3 340		3 84	0,22	
Avon Finance PLC				6,204 % éch. 27/11/2054					5,525 % éch. 12/09/2055		3 340		3 84	0,22		
5,809 % éch. 20/09/2048		4 132	4 814	0,27	IndyMac Mortgage Loan Trust	\$	75	60	0,00	5,715 % éch. 12/03/2055		3 810		4 42	0,25	
Banc of America Funding Trust				5,530 % éch. 25/11/2035 ^		558	443	0,03	6,115 % éch. 12/12/2054		5 572		6 50	0,37		
5,757 % éch. 20/05/2047	\$	60	49	0,00	Jubilee Place BV	€	1 773	1 773	0,10	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust		666		541	0,03	
Barley Hill PLC				4,177 % éch. 17/10/2057					3,974 % éch. 25/07/2037 ^	\$						
5,824 % éch. 27/08/2058	£	1 421	1 646	0,09	Kentmere PLC	£	1 179	1 370	0,08	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust		2 558		2 058	0,12	
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				5,357 % éch. 28/01/2042					4,726 % éch. 25/02/2047 ^							
3,993 % éch. 25/07/2036	\$	226	146	0,01	Lanebrook Mortgage Transaction PLC		2 420	2 824	0,16	Wells Fargo Alternative Loan Trust		24		19	0,00	
4,635 % éch. 25/07/2033		3	3	0,00	5,965 % éch. 12/06/2057				5,134 % éch. 25/07/2037 ^							
5,230 % éch. 25/10/2035		24	21	0,00	Mansard Mortgages PLC		877	1 001	0,06					243 911	13,91	
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				5,651 % éch. 15/12/2049					TITRES ADOSÉS A DES ACTIFS							
3,484 % éch. 26/12/2046 ^		63	44	0,00	MASTR Asset Securitization Trust	\$	95	58	0,00	Accunia European CLO DAC		5 180		5 115	0,29	
Canada Square Funding PLC				6,000 % éch. 25/08/2036 ^		4 917	4 841	0,28	4,127 % éch. 15/07/2030	€						
5,316 % éch. 17/01/2059	£	4 582	5 309	0,30	Miravet SARL	€			ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust		532		181	0,01		
Charter Mortgage Funding PLC				4,265 % éch. 26/05/2065					5,450 % éch. 25/07/2036	\$						
5,327 % éch. 16/01/2057		1 559	1 815	0,10	Newgate Funding PLC	£	230	257	0,01	Ameriquist Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		228		208	0,01	
Chase Mortgage Finance Trust				6,005 % éch. 15/12/2050					5,855 % éch. 25/01/2036							
3,948 % éch. 25/01/2036	\$	2 054	1 657	0,09	Oak No. 4 PLC		3 850	4 493	0,26	Aqueduct European CLO DAC		4 378		4 321	0,25	
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		90	40	0,00	0,000 % éch. 26/02/2065				3,840 % éch. 20/07/2030	€						
Citigroup Mortgage Loan Trust				Paragon Mortgages PLC		610	711	0,04	Ares European CLO DAC		3 197		3 135	0,18		
4,321 % éch. 25/03/2034		1	1	0,00	5,752 % éch. 15/05/2045				3,787 % éch. 15/04/2030		4 670		4 583	0,26		
6,470 % éch. 25/11/2035		14	12	0,00	Pierpont BTL PLC		4 800	5 580	0,32	3,837 % éch. 15/10/2030		4 000		3 934	0,22	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				0,000 % éch. 21/09/2054					4,325 % éch. 21/10/2033							
5,014 % éch. 25/08/2035 ^		237	202	0,01	Polaris PLC		2 870	3 330	0,19	Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV		2 400		2 409	0,14	
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates				5,631 % éch. 23/12/2058		5 697	6 593	0,38	4,072 % éch. 21/09/2031							
3,626 % éch. 25/09/2035 ^		475	378	0,02	5,640 % éch. 23/10/2059		3 675	4 286	0,24	Asset-Backed Funding Certificates Trust		72		51	0,00	
Countrywide Alternative Loan Trust				6,154 % éch. 27/05/2057					6,150 % éch. 25/06/2037	\$						
3,994 % éch. 25/06/2037 ^		35	28	0,00	Precise Mortgage Funding PLC		4 023	4 703	0,27	Aurium CLO DAC		6 047		5 939	0,34	
4,048 % éch. 20/11/2035		267	227	0,01	6,065 % éch. 12/12/2055				3,847 % éch. 16/04/2030	€			4 593	0,26		
4,976 % éch. 25/12/2035		3	3	0,00	Primrose Residential DAC		8 969	8 907	0,51	3,907 % éch. 16/01/2031						
5,250 % éch. 25/06/2035 ^		4	3	0,00	4,189 % éch. 24/03/2061	€		5 358	5 308	0,30	Auto ABS French Leases FCT		5 881		5 899	0,34
5,500 % éch. 25/09/2035 ^		1 411	794	0,05	4,439 % éch. 24/10/2061				4,111 % éch. 29/06/2033							
5,570 % éch. 25/07/2046		118	96	0,01	Residential Accredited Loans, Inc. Trust		322	72	0,00	Autonorica FCT		3 200		3 204	0,18	
6,000 % éch. 25/03/2036 ^		190	80	0,00	4,165 % éch. 25/06/2046	\$	1 016	839	0,05	3,883 % éch. 26/01/2043						
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		292	140	0,01	5,470 % éch. 25/03/2047		1 215	467	0,03	Bain Capital Euro CLO DAC		4 772		4 667	0,27	
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				5,510 % éch. 25/07/2036 ^		46	34	0,00	3,940 % éch. 20/01/2032							
3,514 % éch. 25/04/2035		87	63	0,00	6,000 % éch. 25/05/2037 ^		329	235	0,01	Bavarian Sky S.A.		301		302	0,02	
3,573 % éch. 20/05/2036 ^		46	39	0,00	6,000 % éch. 25/06/2037 ^		1 289	911	0,05	4,055 % éch. 20/05/2027						
5,730 % éch. 25/04/2035		107	91	0,01	Residential Asset Securitization Trust		1 289	911	0,05	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		591		526	0,03	
5,790 % éch. 25/03/2035		146	111	0,01	5,750 % éch. 25/02/2036	£	4 157	4 860	0,28	6,950 % éch. 25/07/2035	\$					
5,890 % éch. 25/02/2035		145	115	0,01	Residential Mortgage Securities PLC					BlueMountain Fuji EUR CLO DAC		99		92	0,01	
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				6,159 % éch. 20/06/2070					1,050 % éch. 15/01/2031	€			2 221	0,12		
5,530 % éch. 25/08/2047		3 092	2 321	0,13	Resloc UK PLC	€	751	717	0,04	3,827 % éch. 15/07/2030				4 573	0,25	
Dilosk RMBS DAC				3,686 % éch. 15/12/2043					3,897 % éch. 15/01/2031				2 000	0,11		
4,133 % éch. 20/02/2060	€	3 300	3 299	0,19	Ripon Mortgages PLC	£	6 578	7 639	0,44	4,087 % éch. 15/01/2033						
4,272 % éch. 20/12/2060		4 791	4 779	0,27	5,491 % éch. 28/08/2056				BNPP AM Euro CLO DAC		1 035		1 011	0,06		
Dutch Property Finance BV				RMAC Securities PLC		58	65	0,00	3,827 % éch. 15/10/2031							
3,872 % éch. 28/04/2051		1 186	1 186	0,07	5,134 % éch. 12/06/2044		1 029	1 148	0,07	Bridgepoint CLO DAC		1 600		1 578	0,09	
3,892 % éch. 28/07/2058		2 394	2 391	0,14	5,154 % éch. 12/06/2044				4,387 % éch. 15/01/2034							
3,942 % éch. 28/04/2059		3 695	3 677	0,21	Shamrock Residential DAC				Bumper UK Finance PLC		1 814		2 114	0,12		
3,992 % éch. 28/10/2059		4 239	4 223	0,24	4,289 % éch. 24/12/2059	€	1 728	1 711	0,10	5,287 % éch. 20/12/2030	£					
4,492 % éch. 28/04/2050		2 442	2 404	0,14	Stanlington PLC	£	3 593	4 170	0,24	Cairn CLO DAC						
EMF-UK PLC				5,815 % éch. 12/06/2045					3,912 % éch. 31/01/2030	€	4 687		4 615	0,26		
5,970 % éch. 13/03/2046	£	4 186	4 832	0,28	Stratton Mortgage Funding PLC		13 928	16 232	0,93	3,971 % éch. 25/04/2032		1 399		1 371	0,08	
European Loan Conduit DAC				5,391 % éch. 20/07/2060		5 279	6 130	0,35	4,051 % éch. 25/07/2029		1 014		1 013	0,06		
4,358 % éch. 17/02/2030	€	5 065	4 959	0,28	5,792 % éch. 25/09/2051		3 283	3 817	0,22	4,212 % éch. 20/10/2028		24		24	0,00	
Eurosaill PLC				Structured Asset Mortgage Investments Trust					Carlyle Euro CLO DAC		6 746		6 595	0,38		
3,619 % éch. 13/03/2045		655	647	0,04	3,907 % éch. 25/02/2036 ^	\$	182	145	0,01	3,953 % éch. 15/08/2030						
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				5,530 % éch. 25/06/2036		48	42	0,00	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC		4 993		4 888	0,28		
4,386 % éch. 25/03/2035	\$	31	18	0,00	5,646 % éch. 19/07/2035		3	3	0,00	3,991 % éch. 25/01/2032						
Glenbeigh Issuer DAC				5,846 % éch. 19/12/2034		57	47	0,00	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.		4 600		4 513	0,26		
4,350 % éch. 24/03/2046	€	1 152	1 148	0,07	5,846 % éch. 19/02/2035		66	56	0,00	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC		1 967		1 971	0,11	
4,350 % éch. 24/06/2050		2 788	2 774	0,16	Towd Point Mortgage Funding PLC											
Great Hall Mortgages PLC				5,161 % éch. 20/10/2051	£	500	577	0,03								
3,677 % éch. 18/03/2039		140	138	0,01	5,635 % éch. 20/10/2051		6 852	7 996	0,46							

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET
Compartiment VCL			Silver Arrow S.A.			3,150 % éch. 30/04/2033	€ 1 254	€ 1 230 0,07
4,072 % éch. 21/01/2028	€ 1 883	€ 1 888 0,11	3,768 % éch. 15/02/2030	€ 2 389	€ 2 391 0,14	3,450 % éch. 30/07/2043	9 100	8 650 0,49
Contego CLO BV			4,028 % éch. 15/02/2027	224	224 0,01	3,450 % éch. 30/07/2066	9 400	8 572 0,49
3,947 % éch. 15/10/2030	3 745	3 687 0,21	SLC Student Loan Trust			3,550 % éch. 31/10/2033	870	878 0,05
Contego CLO DAC			6,271 % éch. 25/11/2042	\$ 560	509 0,03	3,900 % éch. 30/07/2039	1 600	1 636 0,09
3,851 % éch. 23/01/2030	4 588	4 497 0,26	SLM Student Loan Trust			Svensk Exportkredit AB		
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			3,661 % éch. 25/10/2039	€ 426	398 0,02	3,250 % éch. 13/04/2026	5 300	5 245 0,30
4,473 % éch. 25/07/2036	\$ 58	48 0,00	Soundview Home Loan Trust					
5,290 % éch. 25/06/2035	4 136	3 303 0,19	5,650 % éch. 25/10/2036	\$ 4 886	4 181 0,24			
5,370 % éch. 25/06/2047	3 080	2 682 0,15	Tikehau CLO DAC					
5,410 % éch. 25/11/2037	1 934	1 587 0,09	4,144 % éch. 04/08/2034	€ 4 000	3 909 0,22			
5,990 % éch. 25/10/2047	1 112	969 0,05	Toro European CLO DAC					
CVC Cordatus Loan Fund DAC			3,995 % éch. 12/01/2032	3 900	3 825 0,22			
3,827 % éch. 15/10/2031	€ 3 400	3 336 0,19	Turbo Finance PLC					
4,103 % éch. 15/08/2032	3 282	3 221 0,18	5,617 % éch. 20/08/2028	£ 844	984 0,06			
Ellington Loan Acquisition Trust			Voya Euro CLO DAC					
6,200 % éch. 25/05/2037	\$ 2 678	2 308 0,13	3,927 % éch. 15/10/2030	€ 3 067	3 028 0,17			
FCT Pulse France								
4,163 % éch. 25/01/2035	€ 2 900	2 910 0,17						
First Franklin Mortgage Loan Trust								
5,310 % éch. 25/11/2036	\$ 131	118 0,01						
Ginkgo Sales Finance								
4,113 % éch. 25/11/2049	€ 4 842	4 844 0,28						
Harvest CLO DAC								
3,817 % éch. 15/10/2031	5 600	5 467 0,31						
3,880 % éch. 20/10/2031	4 300	4 213 0,24						
3,907 % éch. 15/10/2030	5 676	5 592 0,32						
3,937 % éch. 15/07/2031	5 400	5 270 0,30						
4,027 % éch. 15/01/2032	8 300	8 122 0,46						
Invesco Euro CLO DAC								
3,827 % éch. 15/07/2031	1 550	1 513 0,09						
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust								
5,420 % éch. 25/07/2036	\$ 75	58 0,00						
Jubilee CLO DAC								
4,326 % éch. 15/12/2029	€ 2 777	2 746 0,16						
Laurelin DAC								
3,920 % éch. 20/10/2031	6 000	5 892 0,34						
Lahman XS Trust								
6,500 % éch. 25/06/2046	\$ 2 333	1 805 0,10						
Long Beach Mortgage Loan Trust								
5,450 % éch. 25/05/2036	2 054	1 095 0,06						
5,450 % éch. 25/06/2036	4 742	2 087 0,12						
Man GLG Euro CLO DAC								
3,857 % éch. 15/10/2030	€ 2 271	2 230 0,13						
3,987 % éch. 15/10/2032	4 295	4 184 0,24						
4,047 % éch. 15/01/2030	5 012	4 951 0,28						
MASTR Asset-Backed Securities Trust								
5,300 % éch. 25/10/2036	\$ 3 016	907 0,05						
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust								
5,400 % éch. 25/07/2036	346	273 0,01						
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust								
5,290 % éch. 25/12/2036	2 758	1 228 0,07						
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust								
5,300 % éch. 25/07/2036	516	427 0,02						
5,765 % éch. 25/02/2036	1	1 0,00						
NovaStar Mortgage Funding Trust								
5,350 % éch. 25/09/2037	465	413 0,02						
5,855 % éch. 25/01/2036	102	92 0,01						
OCP Euro CLO DAC								
3,997 % éch. 15/01/2032	€ 4 096	4 043 0,23						
4,091 % éch. 22/09/2034	5 600	5 454 0,31						
Palmer Square European Loan Funding DAC								
3,897 % éch. 15/10/2031	7 036	6 896 0,39						
PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartiment								
4,139 % éch. 26/11/2030	2 412	2 417 0,14						
Red & Black Auto Lease France								
4,093 % éch. 27/06/2035	5 400	5 401 0,31						
Revocar UG								
4,032 % éch. 21/04/2036	4 012	4 024 0,23						
SCF Rahoituspalvelut DAC								
4,020 % éch. 25/06/2033	5 300	5 304 0,30						
Sculptor European CLO DAC								
3,916 % éch. 14/01/2032	4 600	4 519 0,26						
Silver Arrow Athlon NL BV								
4,139 % éch. 26/04/2031	2 895	2 900 0,16						
Silver Arrow Merfina SRL								
4,055 % éch. 20/07/2033	2 956	2 962 0,17						

TITRES PRIVILÉGIÉS

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET
Nationwide Building Society		
10,250 %	903	121 0,01

ACTIONS

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET
SGS Nederland Holding BV		
3,660 % éch. 10/07/2023	€ 5 900	5 894 0,34
Universal Music Group NV		
3,691 % éch. 24/07/2023	2 000	1 996 0,11

INSTRUMENTS À COURT TERME

BILLETTS DE TRÉSORERIE

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET
SGS Nederland Holding BV		
3,660 % éch. 10/07/2023	€ 5 900	5 894 0,34
Universal Music Group NV		
3,691 % éch. 24/07/2023	2 000	1 996 0,11

BONS DU TRÉSOR JAPONAIS

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET
(0,206) % éch.		
18/07/2023 (b)(c)	¥ 5 337 000	33 847 1,93
(0,202) % éch.		
28/08/2023 (b)(c)	5 982 000	37 943 2,16
(0,200) % éch.		
28/08/2023 (b)(c)	1 258 000	7 979 0,46
(0,199) % éch.		
11/09/2023 (b)(c)	4 545 000	28 830 1,64
(0,197) % éch.		
31/07/2023 (b)(c)	1 652 000	10 477 0,60
(0,188) % éch.		
18/07/2023 (b)(c)	943 000	5 981 0,34
(0,179) % éch.		
11/09/2023 (b)(c)	1 015 000	6 438 0,37
(0,178) % éch.		
31/07/2023 (b)(c)	469 000	2 975 0,17
(0,175) % éch.		
07/08/2023 (b)(c)	5 700 000	36 152 2,06
Total des Instruments à court terme		178 512 10,18

Total des Valeurs mobilières

	€ 1 600 490	91,28
--	-------------	-------

ACTIONS

FONDS D'INVESTISSEMENT
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	1 371 800	132 603 7,56
Total des Fonds d'investissement	€ 1 32 603	7,56

Tableau des investissements Fonds Euro 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
COM	3,250 %	30/06/2023	03/07/2023	€ 101 800	État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie 2,350 % éch. 13/12/2029	€ (100 000)	€ 101 800	€ 101 828	5,80
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	\$ 2 666	Billets du Trésor américain 4,625 % éch. 30/06/2025	(8 561) (2 493)	2 444	2 444	0,14
Total des Contrats de mise en pension						€ (111 054)	€ 104 244	€ 104 272	5,94

(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 septembre	Long	09/2023	2 917	€ (4 344)	(0,25)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Long	09/2023	791	612	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	2 615	2 697	0,15
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Long	09/2023	546	984	0,06
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Long	09/2023	1 485	(145)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Long	09/2023	1 472	(975)	(0,06)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	24	(78)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Court	09/2023	444	374	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	1 727	2 784	0,16
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	1 115	(2 036)	(0,12)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	764	718	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	117	29	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	433	(775)	(0,04)
				€ (155)	(0,01)

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 113,000	21/07/2023	320	€ (210)	€ (327)	(0,02)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					€ (482)	(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 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 %	16/06/2029	¥ 7 571 000	€ (557)	(0,03)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,435	20/06/2029	2 729 000	(123)	(0,01)
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,880	25/01/2052	\$ 11 900	(3 063)	(0,17)
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,865	13/02/2054	29 200	577	0,03
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,085	13/02/2034	65 700	(1 075)	(0,06)
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,250	20/12/2025	127 600	703	0,04
À payer	EURIBOR EUR à 3 mois	0,526	21/11/2023	€ 124 100	(2 894)	(0,17)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/07/2023	\$ 11 900	(43)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€ 5 200	(212)	(0,01)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	1,700	15/03/2073	4 900	561	0,03
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037	46 800	(1 127)	(0,06)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2042	21 400	(783)	(0,05)
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	80 600	(887)	(0,05)
À payer ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	196 600	292	0,02
À payer ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	462 100	3 190	0,18
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	104 900	(73)	0,00
À payer	CPTFEMU	1,380	15/03/2031	28 500	(5 877)	(0,34)
À recevoir	CPTFEMU	2,359	15/08/2030	2 800	98	0,01
À payer	CPTFEMU	2,421	15/05/2052	990	(149)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	2,470	15/07/2032	2 300	102	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	CPTFEMU	2,488 %	15/05/2037	€ 6 880	€ (481)	(0,03)
À recevoir	CPTFEMU	2,600	15/05/2032	4 500	193	0,01
À recevoir	CPTFEMU	2,720	15/06/2032	6 600	156	0,01
À recevoir	CPTFEMU	2,975	15/08/2027	6 700	58	0,00
À recevoir	CPTFEMU	3,340	15/08/2027	25 900	(144)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	3,479	18/07/2023	\$ 26 800	189	0,01
					€ (11 369)	(0,65)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					€ (11 369)	(0,65)

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,420 %	21/09/2023	123 100	€ (646)	€ (483)	(0,03)
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	12/09/2023	123 100	€ (327)	€ (130)	(0,01)
							€ (973)	€ (613)	(0,04)

(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 sud-africain	1,000 %	20/12/2023	\$ 200	€ (8)	€ 8	€ 0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	16 800	(655)	657	€ 2	0,00
					€ (663)	€ 665	€ 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	
BOA	07/2023	DKK	60 704	€ 8 152	€ 0	€ 0	0,00	
	07/2023	€	6 636	\$ 7 138	0	(93)	(0,01)	
	08/2023	AUD	220	€ 135	1	0	0,00	
	09/2023	KRW	34 796	\$ 27	1	0	0,00	
	07/2023	€	4 908	DKK 36 575	4	0	0,00	
BPS	07/2023		197 949	\$ 216 893	853	853	0,05	
	08/2023	CNH	19 021	2 770	134	0	0,01	
	08/2023	€	2 587	£ 2 212	0	(14)	0,00	
	08/2023	£	4 009	€ 4 660	0	(2)	0,00	
	08/2023	\$	1 187	CNH 8 204	0	(51)	0,00	
	08/2023	€	217 198	€ 197 949	0	(860)	(0,05)	
	09/2023	IDR	921 895	\$ 61	0	0	0,00	
	07/2023	€	25 363	DKK 188 854	1	0	0,00	
BRC	08/2023	DKK	188 803	€ 25 363	0	(2)	0,00	
	08/2023	€	1 341	¥ 196 700	0	(88)	(0,01)	
CBK	07/2023	\$	3 724	€ 3 452	39	0	0,00	
	09/2023	€	95 160	¥ 14 878 000	0	(107)	(0,01)	
JPM	07/2023	DKK	203 313	€ 27 300	0	(5)	0,00	
	07/2023	€	5 182	DKK 38 590	1	0	0,00	
	08/2023	DKK	38 580	€ 5 182	0	(1)	0,00	
	08/2023	£	71 890	82 559	0	(1 052)	(0,06)	
	08/2023	¥	5 700 000	38 193	1 913	0	1 913	0,11
	08/2023	\$	953	CNH 6 586	0	(41)	(41)	0,00
	09/2023	IDR	1 887 579	\$ 127	1	0	1	0,00
10/2023	MXN	322	18	0	0	0	0,00	

Tableau des investissements Fonds Euro 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
MBC	07/2023	¥ 6 280 000	€ 44 360	€ 4 477	€ 0	€ 4 477	0,25
	07/2023	\$ 2 152	2 012	40	0	40	0,00
	08/2023	€ 15 127	¥ 2 203 529	0	(1 091)	(1 091)	(0,06)
	08/2023	¥ 7 240 000	€ 48 744	2 566	0	2 566	0,15
	09/2023	5 750 000	37 112	327	0	327	0,02
	09/2023	KRW 64 503	\$ 51	1	0	1	0,00
MYI	07/2023	€ 1 472	1 590	0	(15)	(15)	0,00
	07/2023	IDR 16 379	1	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 5 303	€ 4 962	101	0	101	0,01
	07/2023	1	IDR 16 379	0	0	0	0,00
	08/2023	€ 3 504	£ 3 003	0	(11)	(11)	0,00
	08/2023	£ 9 427	€ 10 894	0	(70)	(70)	(0,01)
	09/2023	IDR 507 220	\$ 34	0	0	0	0,00
	09/2023	KRW 72 491	57	1	0	1	0,00
	09/2023	\$ 1	IDR 16 394	0	0	0	0,00
RBC	08/2023	€ 2 073	¥ 306 600	0	(120)	(120)	(0,01)
	08/2023	\$ 543	MXN 9 405	1	0	1	0,00
RYL	08/2023	£ 3 591	€ 4 122	0	(54)	(54)	0,00
SCX	09/2023	¥ 9 128 000	€ 61 631	3 363	0	3 363	0,20
	08/2023	€ 1 198	£ 1 031	2	0	2	0,00
	08/2023	£ 92 347	€ 105 756	0	(1 649)	(1 649)	(0,09)
	08/2023	\$ 454	CNH 3 121	0	(21)	(21)	0,00
	09/2023	IDR 1 566 231	\$ 105	0	0	0	0,00
SOG	07/2023	\$ 210 448	€ 195 631	2 736	0	2 736	0,16
UAG	07/2023	¥ 2 121 000	14 576	1 086	0	1 086	0,06
	09/2023	5 560 000	37 393	1 878	0	1 878	0,11
				€ 19 527	€ (5 347)	€ 14 180	0,82

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 106 043	CHF 102 615	€ 0	€ (906)	€ (906)	(0,05)
BRC	07/2023	48 625	47 213	0	(251)	(251)	(0,01)
MYI	07/2023	CHF 2 464	€ 2 543	19	0	19	0,00
	07/2023	€ 63 959	CHF 62 089	0	(344)	(344)	(0,02)
RBC	07/2023	CHF 2 317	€ 2 358	0	(16)	(16)	0,00
UAG	07/2023	99 885	102 053	0	(287)	(287)	(0,02)
	07/2023	€ 105 868	CHF 102 385	0	(967)	(967)	(0,06)
	08/2023	102 053	99 741	300	0	300	0,02
				€ 319	€ (2 771)	€ (2 452)	(0,14)

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ 11 117 0,64

Total des Investissements

€ 1 836 603 104,74

Autres actifs et passifs à court terme

€ (83 042) (4,74)

Actifs nets

€ 1 753 561 100,00

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) Un titre d'une juste valeur globale de 2 273 € (31 décembre 2022 : 4 360 €) et un montant en numéraire de 1 500 € (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. (ISDA) au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 48 591 € (31 décembre 2022 : 53 376 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	€ 1 600 242	€ 248	€ 1 600 490
Fonds d'investissement	15 515	117 088	0	132 603
Contrats de mise en pension	0	104 244	0	104 244
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(1 249)	515	0	(734)
Totaux	€ 14 266	€ 1 822 089	€ 248	€ 1 836 603

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	€ 1 747 790	€ 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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	€ (1 480)	€ 1 790	€ 310	€ (136)	€ 0	€ (136)
BPS	(66)	0	(66)	(3 776)	1 243	(2 533)
BRC	(340)	580	240	(672)	250	(422)
CBK	(68)	0	(68)	(250)	0	(250)
GLM	S/O	S/O	S/O	(662)	553	(109)
GST	2	11	13	(1 966)	1 883	(83)
JPM	816	(1 331)	(515)	(3 086)	3 064	(22)
MBC	6 320	(6 180)	140	(236)	(390)	(626)
MYC	S/O	S/O	S/O	(26)	70	44
MYI	(319)	424	105	(46)	37	(9)
RBC	(135)	0	(135)	(30)	0	(30)
RYL	3 309	(3 300)	9	(198)	30	(168)
SCX	(1 668)	968	(700)	(313)	373	60
SOG	2 736	(3 010)	(274)	S/O	S/O	S/O
SSB	S/O	S/O	S/O	2 746	(1 770)	976
UAG	2 010	(1 450)	560	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	70,93	71,54
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	20,33	19,58
Autres valeurs mobilières	0,02	0,23
Fonds d'investissement	7,56	9,49
Contrats de mise en pension	5,94	0,60
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,03)	(1,69)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,65)	(1,62)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,64	(0,50)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,01	0,01
Obligations et billets privés	21,42	26,04
Agences du gouvernement américain	8,31	5,29
Obligations du Trésor américain	3,57	2,26
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	13,91	12,23
Titres adossés à des actifs	13,95	12,40
Émissions souveraines	19,92	20,18
Titres privilégiés	0,01	0,07
Instruments à court terme	10,18	12,87
Fonds d'investissement	7,56	9,49
Contrats de mise en pension	5,94	0,60
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,01)	(1,69)
Options vendues		
Options sur 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 défaillance sur indices de crédit - achat de protection	S/O	(0,13)
Swaps de taux d'intérêt	(0,65)	(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	(0,04)	(1,04)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Contrats de change à terme	0,82	0,07
Contrats de change à terme couverts	(0,14)	(0,04)
Autres actifs et passifs à court terme	(4,74)	2,37
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Euro Credit 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 Europe Main 39 à 5 ans	1,000 %	20/06/2028	€ 32 200	€ 195	0,03
Indice iTraxx Europe Main 39 à 10 ans	1,000	20/06/2033	200	1	0,00
				€ 196	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 ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750 %	20/09/2028	£ 5 900	€ 344	0,06
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	¥ 1 860 000	(29)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	16/09/2023	\$ 42 700	(558)	(0,09)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2026	27 600	2 452	0,40
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	16/06/2031	15 100	2 014	0,33
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	23 000	(200)	(0,03)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	3 400	265	0,04
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	16/09/2023	42 700	562	0,09
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,500	09/02/2024	€ 52 200	(1 040)	(0,17)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	8 100	(44)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	35 700	(99)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	30 200	219	0,04
					€ 3 886	0,64
					€ 4 023	0,66

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.

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	07/2023	€ 869	\$ 952	€ 4	€ 0	€ 4	0,00
BPS	07/2023	65 701	71 983	279	0	279	0,04
	08/2023	CNH 404	59	3	0	3	0,00
	08/2023	\$ 68 407	€ 62 345	0	(271)	(271)	(0,04)
BRC	08/2023	£ 120	139	0	(1)	(1)	0,00
CBK	08/2023	CNH 53	\$ 8	0	0	0	0,00
JPM	08/2023	£ 4 138	€ 4 750	0	(63)	(63)	(0,01)
MBC	08/2023	¥ 45 461	312	22	0	22	0,00
MYI	07/2023	\$ 3 269	3 047	51	(1)	50	0,01
	08/2023	€ 1 790	£ 1 534	0	(6)	(6)	0,00
RBC	08/2023	\$ 58	MXN 1 002	0	0	0	0,00
SCX	08/2023	£ 6 562	€ 7 514	0	(117)	(117)	(0,02)
SOG	07/2023	\$ 68 334	63 523	889	0	889	0,15
				€ 1 248	€ (459)	€ 789	0,13

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

Total des Investissements

Autres actifs et passifs à court terme

Actifs nets

€ 789 0,13

€ 613 044 100,51

€ (3 105) (0,51)

€ 609 939 100,00

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) Affilié au Fonds.
 (e) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,08 %) :

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	17/11/2020	€ 337	€ 326	0,05

- (f) Un titre d'une juste valeur globale de 539 € (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 10 762 € (31 décembre 2022 : 25 216 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	€ 528 648	€ 47	€ 528 695
Fonds d'investissement	0	51 452	0	51 452
Contrats de mise en pension	0	28 577	0	28 577
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(1 010)	5 330	0	4 320
Totaux	€ (1 010)	€ 614 007	€ 47	€ 613 044

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 30 juin 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
MYI	1,500 %	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (547)	€ (549)	(0,09)
Total des Contrats de prise en pension					€ (549)	(0,09)

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	€ (60)	€ 0	€ (60)
BPS	11	0	11	40	0	40
BRC	(1)	0	(1)	15	0	15
CBK	0	0	0	(4)	0	(4)
GLM	S/O	S/O	S/O	(1 545)	1 412	(133)
JPM	(63)	0	(63)	26	0	26
MBC	22	0	22	2 095	(1 900)	195
MYC	S/O	S/O	S/O	(5)	0	(5)
MYI	44	0	44	(139)	(50)	(189)
RBC	0	0	0	(30)	0	(30)
SCX	(117)	0	(117)	18	0	18
SOG	889	(1 010)	(121)	S/O	S/O	S/O
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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	81,20	72,82
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	5,47	7,71
Autres valeurs mobilières	S/O	0,07
Fonds d'investissement	8,44	8,31
Contrats de mise en pension	4,69	7,31
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,08)	(0,47)
Instruments financiers dérivés compensés	0,66	(0,30)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,13	0,12
Contrats de prise en pension	(0,09)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	S/O	1,36
Obligations et billets privés	65,46	62,43
Agences du gouvernement américain	1,96	2,01
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	3,18	4,11
Titres adossés à des actifs	4,01	5,19
Émissions souveraines	9,08	0,03
Instruments à court terme	2,98	5,47
Fonds d'investissement	8,44	8,31
Contrats de mise en pension	4,69	7,31
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,08)	(0,47)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,01)	(0,19)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,03	0,02
Swaps de taux d'intérêt	0,64	(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	0,13	0,36
Autres actifs et passifs à court terme	(0,51)	4,43
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 CESSIONS				CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Charter Communications Operating LLC 6,795 % éch. 01/02/2027	\$	2 721	0,19	3,035 % éch. 28/05/2032 (f)	\$	200	0,01	UniCredit SpA 1,982 % éch. 03/06/2027	\$	500	0,03
SCUR-Alpha 1503 GmbH 9,087 % éch. 29/03/2030	€	1 200	0,09	3,547 % éch. 18/09/2031	€	1 100	0,07	3,127 % éch. 03/06/2032	€	6 000	0,34
10,602 % éch. 28/03/2030	\$	2 494	0,17	Digital Euro Fincio LLC 1,125 % éch. 09/04/2028	€	1 300	0,09	Yango Justice International Ltd. 7,875 % éch. 04/09/2024 ^		12 600	0,01
Sigma Bidco BV 6,239 % éch. 02/07/2025	€	1 300	0,10	Digital Intrepid Holding BV 0,625 % éch. 15/07/2031		800	0,04			276 054	21,87
Windstream Services LLC 11,452 % éch. 21/09/2027	\$	2 907	0,20	1,375 % éch. 18/07/2032		7 500	0,43				
Wm Morrison Supermarkets Ltd. 8,073 % éch. 04/11/2027	€	4 500	0,31	DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % éch. 25/01/2027		6 400	0,39				
		13 440	1,06	EQT AB 2,375 % éch. 06/04/2028		1 300	0,09				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
BANQUE ET FINANCE				BANQUE ET FINANCE				BANQUE ET FINANCE			
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC 2,700 % éch. 11/06/2023 ^	\$	8 200	0,10	G City Europe Ltd. 4,250 % éch. 11/09/2025		6 400	0,44	INDUSTRIE			
ABN AMRO Bank NV 2,470 % éch. 13/12/2029	\$	1 300	0,08	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % éch. 29/03/2025		6 600	0,43	Altice Financing S.A. 5,750 % éch. 15/08/2029		6 000	0,34
ADLER Real Estate AG 3,000 % éch. 27/04/2026	€	600	0,04	HSBC Holdings PLC 2,099 % éch. 04/06/2026	\$	600	0,04	Altice France S.A. 3,375 % éch. 01/12/2028	€	5 000	0,29
Altarea S.C.A. 1,750 % éch. 16/01/2030		1 500	0,08	3,973 % éch. 22/05/2030		1 800	0,12	DISH DBS Corp. 5,250 % éch. 01/12/2026	\$	473	0,03
1,875 % éch. 17/01/2028		6 000	0,38	5,402 % éch. 11/08/2033		12 000	0,85	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % éch. 02/10/2026	€	10 100	0,55
Aroundtown S.A. 0,375 % éch. 15/04/2027		1 900	0,11	Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % éch. 21/11/2033		14 275	1,09	Las Vegas Sands Corp. 2,900 % éch. 25/06/2025	\$	1 600	0,11
1,450 % éch. 09/07/2028		700	0,04	Jyske Realkredit A/S 0,500 % éch. 01/10/2043	DKK	0	0,00	Lendlease Europe Finance PLC 3,500 % éch. 02/12/2033	£	164	0,01
1,500 % éch. 28/05/2026 (g)		11 000	0,72	1,000 % éch. 01/10/2050		0	0,00	Mitchells & Butlers Finance PLC 5,451 % éch. 15/12/2030		427	0,04
5,375 % éch. 21/03/2029	\$	3 600	0,19	1,000 % éch. 01/10/2053		0	0,00	6,002 % éch. 15/12/2030	\$	738	0,05
Atrium Finance PLC 2,625 % éch. 05/09/2027	€	2 200	0,13	1,500 % éch. 01/10/2037		0	0,00	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % éch. 17/09/2027		1 200	0,08
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % éch. 15/02/2025	\$	6 000	0,41	1,500 % éch. 01/10/2050		0	0,00	Q-Park Holding BV 3,500 % éch. 01/02/2025	€	7 800	0,58
Balder Finland Oyj 1,000 % éch. 20/01/2029	€	800	0,04	Kaisa Group Holdings Ltd. 10,875 % éch. 23/07/2023 ^	\$	5 400	0,31	Roadster Finance DAC 1,625 % éch. 09/12/2029		200	0,01
2,000 % éch. 18/01/2031		6 500	0,31	11,500 % éch. 30/01/2023 ^		3 500	0,22	2,375 % éch. 08/12/2032		400	0,02
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,625 % éch. 24/09/2024		8 500	0,65	11,650 % éch. 01/06/2026 ^		4 000	0,22	Syngenta Finance NV 4,892 % éch. 24/04/2025	\$	6 564	0,47
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,138 % éch. 14/09/2028	\$	1 100	0,08	KBC Group NV 5,796 % éch. 19/01/2029		2 000	0,14	Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % éch. 24/11/2027	€	8 600	0,52
Barclays PLC 7,437 % éch. 02/11/2033		24 076	1,89	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % éch. 12/11/2025	€	5 800	0,41	Windstream Escrow LLC 7,750 % éch. 15/08/2028	\$	1 800	0,11
BNP Paribas S.A. 1,904 % éch. 30/09/2028		2 300	0,14	Logicor Financing SARL 1,500 % éch. 13/07/2026		2 600	0,18			40 524	3,21
BPCE S.A. 5,748 % éch. 19/07/2033		12 100	0,86	1,625 % éch. 17/01/2030		3 600	0,21				
Castellum Helsinki Finance Holding Abp 0,875 % éch. 17/09/2029	€	4 700	0,26	NatWest Group PLC 6,016 % éch. 02/03/2034	\$	12 200	0,89	SERVICES AUX COLLECTIVITÉS			
2,000 % éch. 24/03/2025		5 500	0,40	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,500 % éch. 01/10/2043	DKK	0	0,00	Pacific Gas & Electric Co. 6,100 % éch. 15/01/2029		5 000	0,36
Citycon Treasury BV 1,625 % éch. 12/03/2028		10 600	0,61	1,000 % éch. 01/10/2050		0	0,00	6,400 % éch. 15/06/2033		5 000	0,36
Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % éch. 31/07/2023 ^		11 600	0,13	1,000 % éch. 01/10/2053		0	0,00	6,750 % éch. 15/01/2053		3 000	0,22
Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % éch. 12/07/2026	\$	2 600	0,06	1,500 % éch. 01/10/2037		0	0,00			11 791	0,94
3,125 % éch. 22/10/2025		1 500	0,03	1,500 % éch. 01/10/2050		0	0,00	Total des Obligations et billets privés		328 369	26,02
CPI Property Group S.A. 1,625 % éch. 23/04/2027	€	9 300	0,54	2,500 % éch. 01/10/2036		0	0,00	OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES			
2,750 % éch. 12/05/2026		100	0,01	Realkredit Danmark A/S 2,500 % éch. 01/04/2036		0	0,00	Corestate Capital Holding S.A. 1,375 % éch. 31/07/2023 ^	€	7 800	0,09
Credit Suisse AG 6,500 % éch. 08/08/2023 (e)	\$	11 200	0,81	Sagax AB 1,125 % éch. 30/01/2027	€	7 082	0,47	AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Cromwell Ereit Lux Fincio SARL 2,125 % éch. 19/11/2025	€	10 000	0,68	2,000 % éch. 17/01/2024		332	0,03	Ginnie Mae, TBA 5,000 % éch. 01/07/2053	\$	3 100	0,22
CTP NV 0,625 % éch. 27/09/2026		1 600	0,10	2,250 % éch. 13/03/2025		5 100	0,38	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 3,000 % éch. 01/05/2052		1 295	0,08
1,250 % éch. 21/06/2029		7 000	0,40	Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % éch. 26/01/2028		1 400	0,08	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,000 % éch. 01/08/2053		23 900	1,53
1,500 % éch. 27/09/2031		1 500	0,08	1,000 % éch. 17/05/2029		1 700	0,10	5,000 % éch. 01/08/2053		29 100	2,07
Deutsche Bank AG 1,375 % éch. 17/02/2032		700	0,04	Santander UK Group Holdings PLC 2,896 % éch. 15/03/2032	\$	13 185	0,78	5,500 % éch. 01/08/2053		92 300	6,67
1,750 % éch. 19/11/2030		6 200	0,39	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % éch. 22/08/2026	€	3 700	0,24	6,000 % éch. 01/08/2053		268 100	19,64
2,129 % éch. 24/11/2026 (f)	\$	2 800	0,18	1,750 % éch. 24/11/2028		3 500	0,20	6,500 % éch. 01/07/2053		55 400	4,11
2,552 % éch. 07/01/2028		3 600	0,23	Société Générale S.A. 2,797 % éch. 19/01/2028	\$	10 800	0,70			433 174	34,32
				6,446 % éch. 10/01/2029		7 700	0,56	TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
				6,691 % éch. 10/01/2034		300	0,02	Alba PLC 5,261 % éch. 15/12/2038	£	1 519	0,13
				Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % éch. 28/04/2024 ^		2 200	0,02	American Home Mortgage Assets Trust 4,896 % éch. 25/11/2046	\$	446	0,01
				6,500 % éch. 28/01/2026 ^		4 200	0,05	5,360 % éch. 25/12/2046		1 355	0,08
				UBS Group AG 3,750 % éch. 26/03/2025		1 550	0,11	Atlas Funding PLC 5,432 % éch. 25/07/2058	£	701	0,07
				7,750 % éch. 01/03/2029	€	6 400	0,56	Atrium Hotel Portfolio Trust 7,093 % éch. 15/06/2035	\$	9 700	0,67

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
Banc of America Alternative Loan Trust				6,500 % éch. 25/08/2037 ^	\$ 339	€ 136	0,01	Jupiter Mortgage PLC			
1,490 % éch. 25/06/2037 ^ (a)	237	€ 18	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				5,891 % éch. 20/07/2060	£ 24 700	€ 28 702	2,27
5,500 % éch. 25/10/2033	174	153	0,01	5,630 % éch. 25/04/2036 ^	159	123	0,01	Lavender Trust			
5,510 % éch. 25/06/2037	219	149	0,01	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				6,250 % éch. 25/10/2036	\$ 165	79	0,01
6,000 % éch. 25/07/2046 ^	216	167	0,01	3,611 % éch. 25/09/2047 ^	64	52	0,00	Lehman Mortgage Trust			
Banc of America Funding Trust				3,677 % éch. 20/02/2036	133	105	0,01	4,599 % éch. 25/12/2035	159	29	0,00
3,811 % éch. 20/09/2046 ^	39	31	0,00	3,842 % éch. 25/01/2036 ^	29	24	0,00	5,039 % éch. 25/01/2036 ^	46	38	0,00
4,106 % éch. 20/04/2035 ^	53	43	0,00	3,861 % éch. 20/12/2035 ^	53	41	0,00	Lehman XS Trust			
4,245 % éch. 20/11/2035 ^	72	59	0,01	3,876 % éch. 25/11/2037	87	70	0,01	5,510 % éch. 25/12/2036	723	643	0,05
4,287 % éch. 20/09/2046 ^	24	21	0,00	4,239 % éch. 20/09/2036 ^	23	19	0,00	Ludgate Funding PLC			
5,537 % éch. 20/10/2036	69	51	0,00	5,750 % éch. 25/03/2035	262	164	0,01	3,212 % éch. 01/01/2061	€ 5 036	4 813	0,38
5,570 % éch. 25/04/2037 ^	62	47	0,00	5,750 % éch. 25/12/2035 ^	65	30	0,00	3,654 % éch. 01/12/2060	3 036	2 912	0,23
6,000 % éch. 25/08/2037 ^	250	180	0,02	5,770 % éch. 25/03/2035	16	12	0,00	Mansard Mortgages PLC			
Banc of America Mortgage Trust				5,890 % éch. 25/02/2035	177	140	0,01	5,651 % éch. 15/12/2049	£ 39	45	0,00
6,000 % éch. 25/10/2036 ^	9	7	0,00	6,000 % éch. 25/03/2037 ^	92	41	0,00	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
BCAP LLC Trust				6,000 % éch. 25/04/2037 ^	14	6	0,00	3,515 % éch. 25/03/2035	\$ 13	10	0,00
3,857 % éch. 26/03/2037	59	43	0,00	6,000 % éch. 25/07/2037	161	69	0,01	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust			
4,048 % éch. 27/03/2037	225	170	0,01	6,500 % éch. 25/11/2036 ^	263	92	0,01	6,000 % éch. 25/05/2037 ^	124	89	0,01
5,500 % éch. 25/11/2034 ^	13	9	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				6,000 % éch. 25/01/2036 ^	160	94	0,01	3,738 % éch. 25/03/2036 ^	267	138	0,01
4,375 % éch. 25/02/2035	6	5	0,00	6,300 % éch. 25/09/2034 ^	22	27	0,00	Miravet SARL			
4,791 % éch. 25/08/2035	5	4	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				4,265 % éch. 26/05/2065	€ 5 263	5 182	0,41
6,662 % éch. 25/12/2046 ^	172	128	0,01	5,450 % éch. 25/08/2036 ^	1 199	297	0,02	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
Bear Stearns ALT-A Trust				6,000 % éch. 25/07/2036	183	89	0,01	4,148 % éch. 25/03/2036 ^	\$ 106	62	0,01
3,731 % éch. 25/11/2036 ^	67	29	0,00	6,500 % éch. 25/10/2021 ^	199	12	0,00	5,962 % éch. 25/06/2036 ^	4 377	1 214	0,10
3,859 % éch. 25/09/2035 ^	146	55	0,01	6,500 % éch. 25/02/2022 ^	513	58	0,01	6,000 % éch. 25/10/2037 ^	112	62	0,01
3,971 % éch. 25/05/2036 ^	295	137	0,01	Credit Suisse Mortgage Capital Trust				6,201 % éch. 25/02/2047	3 017	1 057	0,08
4,941 % éch. 25/07/2035 ^	326	218	0,02	7,093 % éch. 15/07/2032	1 024	852	0,07	Newgate Funding PLC			
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust				4,126 % éch. 15/12/2050	€ 193	186	0,02
5,750 % éch. 25/11/2034 ^	166	131	0,01	5,450 % éch. 25/04/2037	180	111	0,01	4,600 % éch. 01/12/2050	£ 1 107	1 234	0,10
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates				6,005 % éch. 15/12/2050	153	171	0,01
7,500 % éch. 25/08/2036	3	3	0,00	4,057 % éch. 27/06/2037	2 915	2 373	0,19	Nomura Resecuritization Trust			
Bridgeway Funding PLC				Dutch Property Finance BV				6,050 % éch. 25/03/2037	\$ 3 626	3 180	0,25
6,716 % éch. 16/10/2062	£ 24 122	28 078	2,23	3,992 % éch. 28/10/2059	€ 6 819	6 793	0,54	Primrose Residential DAC			
BX Trust				4,168 % éch. 28/04/2064	15 994	16 033	1,27	4,439 % éch. 24/10/2061	€ 4 667	4 623	0,37
7,213 % éch. 15/05/2030	\$ 1 015	911	0,07	EuroMASTR PLC				Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
8,468 % éch. 15/07/2034	1 624	1 485	0,12	5,205 % éch. 15/06/2040	£ 120	129	0,01	5,770 % éch. 25/06/2037 ^	\$ 51	40	0,00
9,568 % éch. 15/07/2034	3 400	3 102	0,25	First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				6,000 % éch. 25/06/2036 ^	57	42	0,00
Chase Mortgage Finance Trust				4,802 % éch. 25/01/2036 ^	\$ 141	69	0,01	6,000 % éch. 25/05/2037 ^	46	34	0,00
3,814 % éch. 25/01/2036 ^	194	152	0,01	5,229 % éch. 25/04/2036 ^	46	36	0,00	6,250 % éch. 25/02/2037 ^	123	92	0,01
3,848 % éch. 25/03/2037 ^	22	18	0,00	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				Residential Asset Securitization Trust			
6,000 % éch. 25/05/2037 ^	96	43	0,00	4,283 % éch. 25/11/2037 ^	28	22	0,00	6,000 % éch. 25/02/2036	322	136	0,01
ChaseFlex Trust				Glenbeigh Issuer DAC				6,000 % éch. 25/06/2036	145	58	0,01
5,000 % éch. 25/07/2037 ^	71	22	0,00	4,350 % éch. 24/06/2050	€ 13 380	13 317	1,06	6,000 % éch. 25/11/2036 ^	121	43	0,00
ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				GSC Capital Corp. Mortgage Trust				6,000 % éch. 25/03/2037 ^	97	31	0,00
4,176 % éch. 25/08/2037 ^	22	17	0,00	5,510 % éch. 25/05/2036 ^	\$ 64	54	0,01	6,000 % éch. 25/05/2037 ^	644	338	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust				GSR Mortgage Loan Trust				6,250 % éch. 25/11/2036 ^	83	30	0,00
3,857 % éch. 25/03/2037 ^	40	32	0,00	5,500 % éch. 25/06/2035	100	90	0,01	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
4,041 % éch. 25/04/2037 ^	168	131	0,01	HarborView Mortgage Loan Trust				6,000 % éch. 25/10/2036 ^	49	34	0,00
5,480 % éch. 25/12/2034	4	3	0,00	3,784 % éch. 19/12/2035 ^	84	42	0,00	RMAC Securities PLC			
5,500 % éch. 25/12/2035	109	56	0,01	4,032 % éch. 19/06/2036 ^	90	47	0,00	3,756 % éch. 12/06/2044	€ 3 868	3 611	0,29
6,250 % éch. 25/11/2037	139	61	0,01	4,596 % éch. 19/12/2035 ^	16	14	0,00	5,154 % éch. 12/06/2044	£ 412	459	0,04
CitiMortgage Alternative Loan Trust				Harbour				5,254 % éch. 12/06/2044	4 103	4 494	0,36
6,000 % éch. 25/01/2037 ^	216	176	0,01	5,457 % éch. 28/01/2054	£ 5 700	6 552	0,52	Shamrock Residential DAC			
6,000 % éch. 25/06/2037 ^	357	283	0,02	Hops Hill PLC				4,439 % éch. 24/06/2071	€ 14 592	14 446	1,15
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				5,854 % éch. 27/05/2054	866	1 010	0,08	Southern Pacific Securities PLC			
5,019 % éch. 25/08/2037 ^	56	25	0,00	HSI Asset Loan Obligation Trust				4,016 % éch. 10/03/2044	2 548	2 514	0,20
6,000 % éch. 25/08/2037 ^	49	23	0,00	6,000 % éch. 25/06/2037 ^	\$ 74	59	0,01	Stratton Mortgage Funding PLC			
Countrywide Alternative Loan Trust				Impac Secured Assets Trust				6,991 % éch. 20/07/2060	£ 5 594	6 428	0,51
3,842 % éch. 25/05/2036	11	8	0,00	5,450 % éch. 25/11/2036	40	37	0,00	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,897 % éch. 25/09/2034	4	3	0,00	IndyMac Mortgage Loan Trust				4,200 % éch. 25/02/2036 ^	\$ 53	39	0,00
3,994 % éch. 25/06/2037 ^	47	38	0,00	3,367 % éch. 25/06/2036	39	28	0,00	4,968 % éch. 25/10/2035 ^	119	97	0,01
5,500 % éch. 25/03/2035	5 356	4 276	0,34	3,510 % éch. 25/11/2035 ^	81	65	0,01	SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
5,500 % éch. 25/11/2035	75	43	0,00	3,747 % éch. 25/06/2037 ^	1 064	677	0,05	4,078 % éch. 25/02/2037 ^	75	59	0,01
5,500 % éch. 25/12/2035 ^	62	32	0,00	5,400 % éch. 25/09/2037	3 873	3 476	0,28	TBW Mortgage-Backed Trust			
5,500 % éch. 25/02/2036 ^	47	26	0,00	5,770 % éch. 25/10/2036	9 556	4 848	0,38	6,300 % éch. 25/03/2037	8 467	1 884	0,15
5,750 % éch. 25/04/2047 ^	97	51	0,00	5,870 % éch. 25/01/2035	46	30	0,00	Tower Bridge Funding PLC			
6,000 % éch. 25/03/2036 ^	200	85	0,01	6,250 % éch. 25/11/2037 ^	42	18	0,00	5,991 % éch. 20/10/2064	£ 10 400	12 188	0,97
6,000 % éch. 25/05/2036 ^	985	476	0,04	JPMorgan Alternative Loan Trust				7,641 % éch. 20/10/2064	2 300	2 694	0,21
6,000 % éch. 25/05/2036	149	78	0,01	3,790 % éch. 25/12/2036	4	3	0,00	UBS Commercial Mortgage Trust			
6,000 % éch. 25/08/2036 ^	31	18	0,00	5,630 % éch. 25/10/2036	2 810	2 300	0,18	6,693 % éch. 15/02/2032	\$ 7 520	6 654	0,53
6,000 % éch. 25/08/2036	161	91	0,01	5,660 % éch. 27/06/2037	169	112	0,01	Uropa Securities PLC			
6,000 % éch. 25/04/2037 ^	59	32	0,00	6,500 % éch. 25/03/2036 ^	183	98	0,01	3,405 % éch. 10/10/2040	€ 1 612	1 497	0,12
6,000 % éch. 25/05/2037 ^	783	349	0,03	6,550 % éch. 25/05/2036	4	3	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,000 % éch. 25/08/2037 ^	314	151	0,01	Jubilee Place BV				3,633 % éch. 25/12/2036 ^	\$ 238	189	0,02
6,250 % éch. 25/07/2036 ^	1 351	612	0,05	4,027 % éch. 17/01/2059	€ 5 474	5 462	0,43	3,712 % éch. 25/10/2036 ^	30	24	0,00
6,250 % éch. 25/12/2036 ^	20	9	0,00	4,177 % éch. 17/10/2057	1 197	1 197	0,10				
6,500 % éch. 25/12/2036 ^	59	26	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
3,765 % éch. 25/12/2035	\$ 10	9	0,00	Centex Home Equity Loan Trust				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
3,974 % éch. 25/05/2037 ^	43	35	0,00	6,200 % éch. 25/10/2035	\$ 4 024	€ 3 527	0,28	5,450 % éch. 25/11/2037	610	197	0,02
5,930 % éch. 25/10/2044	56	48	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust				5,690 % éch. 25/04/2047	1 539	588	0,05
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				6,851 % éch. 25/05/2036 ^	129	47	0,00	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
4,746 % éch. 25/04/2047	355	258	0,02	Contego CLO BV				5,260 % éch. 25/02/2037	\$ 477	€ 140	0,01
6,000 % éch. 25/07/2036 ^	95	61	0,01	3,947 % éch. 15/10/2030	€ 1 298	1 278	0,10	5,280 % éch. 25/01/2037	98	41	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037 ^	25	21	0,00	Contego CLO DAC				5,290 % éch. 25/10/2036	107	43	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust				3,851 % éch. 23/01/2030	5 535	5 425	0,43	5,330 % éch. 25/03/2037	321	130	0,01
6,250 % éch. 25/11/2037 ^	29	23	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				5,350 % éch. 25/09/2036	55	19	0,00
		235 717	18,68	5,430 % éch. 25/12/2046	\$ 3 298	2 772	0,22	5,350 % éch. 25/02/2037	109	48	0,00
				5,690 % éch. 25/03/2036	1 050	831	0,07	5,400 % éch. 25/03/2037	321	130	0,01
				Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				5,450 % éch. 25/09/2036	328	113	0,01
				3,156 % éch. 25/01/2037 ^	2 093	600	0,05	6,125 % éch. 25/02/2035	2 379	1 557	0,12
				CVC Cordatus Loan Fund DAC				6,200 % éch. 25/06/2033	4	4	0,00
				3,855 % éch. 21/07/2030	€ 10 744	10 567	0,84	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
				4,103 % éch. 15/08/2032	199	195	0,02	5,320 % éch. 25/04/2037	260	125	0,01
				4,305 % éch. 26/08/2032	500	489	0,04	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
				4,447 % éch. 17/06/2032	1 300	1 271	0,10	5,680 % éch. 25/04/2037	2 307	774	0,06
				Dryden Euro CLO DAC				5,690 % éch. 25/04/2037	2 307	774	0,06
				4,073 % éch. 15/05/2032	579	564	0,04	6,465 % éch. 25/09/2046 ^	285	89	0,01
				4,183 % éch. 15/05/2034	300	294	0,02	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
				Fieldstone Mortgage Investment Trust				6,532 % éch. 25/10/2036 ^	154	34	0,00
				5,930 % éch. 25/12/2035	\$ 5 000	3 880	0,31	NovaStar Mortgage Funding Trust			
				First NLC Trust				5,450 % éch. 25/06/2036	82	53	0,00
				5,290 % éch. 25/08/2037	139	65	0,01	5,450 % éch. 25/09/2036	149	59	0,00
				5,430 % éch. 25/08/2037	46	22	0,00	5,470 % éch. 25/05/2036	283	254	0,02
				Fremont Home Loan Trust				Oak Hill European Credit Partners DAC			
				5,270 % éch. 25/01/2037	10 377	4 399	0,35	3,930 % éch. 20/01/2032	€ 2 940	2 875	0,23
				5,300 % éch. 25/01/2037	214	91	0,01	Oak Hill European Credit Partners Ltd.			
				5,470 % éch. 25/08/2036	185	57	0,00	4,100 % éch. 22/07/2030	1 267	1 262	0,10
				5,490 % éch. 25/02/2037	650	205	0,02	QCP Euro CLO DAC			
				6,020 % éch. 25/11/2034	1 297	1 031	0,08	3,997 % éch. 15/01/2032	4 688	4 628	0,37
				6,080 % éch. 25/04/2035	3 128	2 739	0,22	Option One Mortgage Loan Trust			
				Griffith Park CLO DAC				5,250 % éch. 25/07/2036	\$ 10 557	4 349	0,34
				4,103 % éch. 21/11/2031	€ 3 300	3 238	0,26	5,330 % éch. 25/04/2037	13 384	6 928	0,55
				GSAA Home Equity Trust				5,370 % éch. 25/01/2037	256	135	0,01
				5,772 % éch. 25/11/2036 ^	\$ 124	35	0,00	5,480 % éch. 25/04/2037	99	45	0,00
				GSAMP Trust				Palmer Square Home Loan Funding DAC			
				5,250 % éch. 25/12/2046	185	85	0,01	3,897 % éch. 15/10/2031	€ 5 535	5 425	0,43
				5,290 % éch. 25/12/2036	843	418	0,03	Palmerston Park CLO DAC			
				5,300 % éch. 25/12/2046	508	234	0,02	3,825 % éch. 18/04/2030	1 259	1 242	0,10
				5,350 % éch. 25/11/2036	190	84	0,01	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
				5,380 % éch. 25/12/2046	92	43	0,00	5,885 % éch. 25/08/2035	\$ 399	351	0,03
				5,450 % éch. 25/09/2036	355	118	0,01	Purple Finance CLO DAC			
				Harvest CLO DAC				4,200 % éch. 20/04/2032	€ 1 200	1 177	0,09
				3,817 % éch. 15/10/2031	€ 1 400	1 367	0,11	Renaissance Home Equity Loan Trust			
				3,907 % éch. 15/01/2031	931	915	0,07	5,879 % éch. 25/06/2037 ^	\$ 3 494	962	0,08
				4,150 % éch. 20/10/2032	2 000	1 948	0,15	6,950 % éch. 25/09/2037	144	110	0,01
				4,252 % éch. 18/11/2030	2 217	2 176	0,17	7,238 % éch. 25/09/2037 ^	212	85	0,01
				HSI Asset Securitization Corp. Trust				Residential Asset Mortgage Products Trust			
				5,370 % éch. 25/12/2036	\$ 198	49	0,00	6,095 % éch. 25/10/2035	3 000	2 240	0,18
				5,490 % éch. 25/12/2036	953	235	0,02	Residential Asset Securities Corp. Trust			
				5,525 % éch. 25/05/2037	4 600	4 043	0,32	5,410 % éch. 25/11/2036	687	579	0,05
				5,590 % éch. 25/12/2036	552	137	0,01	6,110 % éch. 25/01/2036	3 300	2 703	0,21
				JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				Rockford Tower Europe CLO DAC			
				6,080 % éch. 25/06/2035	4 968	4 091	0,32	4,577 % éch. 20/12/2031	€ 559	549	0,04
				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
				6,337 % éch. 25/08/2036 ^	90	49	0,00	5,330 % éch. 25/07/2036	\$ 192	62	0,01
				Jubilee CLO DAC				5,470 % éch. 25/07/2036	188	60	0,01
				3,787 % éch. 15/04/2030	€ 700	686	0,05	5,630 % éch. 25/07/2036	161	52	0,00
				4,326 % éch. 15/12/2029	949	938	0,07	5,650 % éch. 25/03/2036	3 048	1 752	0,14
				Lehman XS Trust				5,650 % éch. 25/05/2036	661	326	0,03
				5,320 % éch. 25/02/2037 ^	\$ 977	673	0,05	Segovia European CLO DAC			
				Mackay Shields Euro CLO DAC				3,945 % éch. 18/01/2031	€ 264	259	0,02
				4,130 % éch. 20/10/2032	€ 1 300	1 267	0,10	4,080 % éch. 20/07/2032	2 000	1 949	0,15
				Man GLG Euro CLO DAC				Soundview Home Loan Trust			
				3,857 % éch. 15/10/2030	513	504	0,04	3,904 % éch. 25/04/2035	\$ 1 588	1 423	0,11
				4,047 % éch. 15/01/2030	3 078	3 040	0,24	5,260 % éch. 25/02/2037	263	69	0,01
				Marlay Park CLO DAC				5,330 % éch. 25/02/2037	388	102	0,01
				3,917 % éch. 15/10/2030	1 301	1 282	0,10	5,430 % éch. 25/06/2037	138	85	0,01
				MASTR Asset-Backed Securities Trust				5,825 % éch. 25/06/2035	2 718	2 405	0,19
				5,250 % éch. 25/11/2036	\$ 136	41	0,00	6,150 % éch. 25/09/2037	7 798	4 858	0,39
				5,450 % éch. 25/08/2036	236	85	0,01	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
				5,630 % éch. 25/06/2036	128	45	0,00	5,450 % éch. 25/09/2037	65	41	0,00
				5,630 % éch. 25/08/2036	141	51	0,00	St. Paul's CLO DAC			
								3,937 % éch. 17/07/2030	€ 1 494	1 470	0,12
								Structured Asset Investment Loan Trust			
								5,300 % éch. 25/09/2036	\$ 25	22	0,00

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	
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 6,900 % éch. 25/04/2031	\$ 1 879	€ 1 704	0,14	3,424 % éch. 14/09/2023 (b)(c)	€ 10 180	€ 10 111	0,80	BONS DU TRÉSOR ALLEMAND				
Toro European CLO DAC 3,917 % éch. 15/10/2030	€ 1 103	1 082	0,09	3,425 % éch. 14/09/2023 (b)(c)	1 250	1 242	0,10	3,322 % éch. 18/10/2023 (b)(c)	€ 23 400	€ 23 167	1,84	
3,995 % éch. 12/01/2032	9 200	9 023	0,72	3,426 % éch. 14/09/2023 (b)(c)	1 850	1 838	0,14	BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
4,097 % éch. 15/07/2030	1 515	1 504	0,12	3,427 % éch. 14/09/2023 (b)(c)	9 030	8 969	0,71	(0,248) % éch. 03/07/2023 (b)(c)	¥ 7 182 400	45 549	3,61	
Voya Euro CLO DAC 3,927 % éch. 15/10/2030	4 121	4 069	0,32			37 963	3,01	(0,229) % éch. 03/07/2023 (b)(c)	2 697 600	17 107	1,35	
		199 546	15,81							62 656	4,96	
ÉMISSIONS SOUVERAINES				BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILITÉ								
Obligation internationale du gouvernement russe 2,875 % éch. 04/12/2025 ^	4 000	2 330	0,18	3,337 % éch. 07/09/2023 (b)(c)	2 180	2 166	0,17	Total des Instruments à court terme		174 531	13,83	
Obligation internationale du gouvernement ukrainien 7,750 % éch. 01/09/2025 ^	\$ 6 500	1 521	0,12	3,347 % éch. 07/09/2023 (b)(c)	1 520	1 511	0,12					
		3 851	0,30			3 677	0,29	Total des Valeurs mobilières	€ 1 389 763	110,11		
INSTRUMENTS À COURT TERME				BONS DU TRÉSOR DE L'UNION EUROPÉENNE								
BILLETTS À COURT TERME				3,168 % éch. 04/08/2023 (b)(c)	900	898	0,07	ACTIONS				
Corestate Capital Holding S.A. 15,000 % éch. 31/07/2023 (f)	€ 700	707	0,06	3,172 % éch. 04/08/2023 (b)(c)	1 800	1 795	0,14	FONDS D'INVESTISSEMENT				
				3,173 % éch. 04/08/2023 (b)(c)	4 650	4 637	0,37	ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
BONS DU TRÉSOR BELGE				3,174 % éch. 04/08/2023 (b)(c)	650	648	0,05	PIMCO Funds: Global Investors				
2,979 % éch. 13/07/2023 (b)(c)	1 600	1 599	0,13	3,179 % éch. 04/08/2023 (b)(c)	2 900	2 892	0,23	Series plc - Fonds PIMCO				
3,039 % éch. 13/07/2023 (b)(c)	5 180	5 176	0,41	3,326 % éch. 08/09/2023 (b)(c)	2 260	2 246	0,18	European High Yield Bond				
3,369 % éch. 14/09/2023 (b)(c)	3 790	3 764	0,30	3,638 % éch. 08/12/2023 (b)(c)	680	669	0,05	1 494 064		15 508	1,23	
3,411 % éch. 14/09/2023 (b)(c)	3 040	3 019	0,24	3,654 % éch. 08/12/2023 (b)(c)	2 690	2 648	0,21	FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE				
3,421 % éch. 14/09/2023 (b)(c)	2 260	2 245	0,18	3,655 % éch. 08/12/2023 (b)(c)	760	748	0,06	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro				
				3,658 % éch. 08/12/2023 (b)(c)	1 560	1 536	0,12	Short Maturity UCITS ETF (d)				
				3,663 % éch. 08/12/2023 (b)(c)	3 850	3 790	0,30	1 123 300		108 537	8,60	
						22 507	1,78	Total des Fonds d'investissement	€ 124 045	9,83		
				BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS								
				3,350 % éch. 30/08/2023 (b)(c)	16 470	16 384	1,30					
				3,387 % éch. 13/09/2023 (b)(c)	7 520	7 470	0,59					
						23 854	1,89					

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	3,250 %	30/06/2023	03/07/2023	€ 122 400	État de Brandebourg 0,010 % échéance 02/06/2025 État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie 0,250 % échéance 13/03/2026	€ (100 000)	€ 122 400	€ 122 433	9,70
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	\$ 299	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	(32 863)	(280)	274	0,02
Total des Contrats de mise en pension						€ (133 143)	€ 122 674	€ 122 707	9,72

⁽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 septembre	Long	09/2023	201	€ (255)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	3 522	2 964	0,23
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	1 092	(757)	(0,06)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Long	09/2023	802	(901)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	19	19	0,00
				€ 1 070	0,08

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	81	€ (33)	€ (28)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	81	(26)	(3)	0,00
Option de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	123,000	21/07/2023	15	(5)	(2)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	131,000	21/07/2023	15	(7)	(3)	0,00
				€ (71)	€ (36)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					€ 1 034	0,08

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	€ (99)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	2 400	(22)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	1 100	8	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2025	200	5	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	8 700	26	0,00
				€ (82)	(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 à 5 ans	5,000 %	20/12/2027	\$ 16 335	€ 671	0,05
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	5,000	20/06/2028	120 900	3 114	0,25
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	3 400	22	0,00
				€ 3 807	0,30

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	3,250 %	20/09/2053	£ 2 600	€ (213)	(0,02)
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	25 900	1 510	0,12
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	¥ 8 530 000	688	0,05
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/08/2023	\$ 220 700	2 789	0,22
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,270	04/11/2023	220 700	(3 966)	(0,31)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,868	05/05/2032	15 100	(1 757)	(0,14)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,040	25/05/2032	7 800	(797)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,068	11/05/2032	15 400	(1 572)	(0,12)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,153	18/05/2032	15 400	(1 456)	(0,12)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	39 900	1 875	0,15
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	3 085	(92)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,300	06/03/2033	2 600	(56)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,300	14/06/2033	9 700	(157)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,420	24/05/2033	7 600	(65)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,425	01/03/2033	40 200	(471)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,450	07/03/2033	5 000	(49)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/06/2030	12 200	(100)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	21/06/2033	8 100	(5)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	1 800	(23)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	21/06/2025	74 000	(1 249)	(0,10)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	15/03/2030	46 000	1 233	0,10
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	5 000	(38)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/08/2023	220 700	(2 775)	(0,22)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,500	09/02/2024	€ 115 000	(2 290)	(0,18)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052	26 700	1 184	0,09
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,520	07/07/2027	9 600	(617)	(0,05)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	41 200	(121)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	133 900	340	0,03
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,150	30/01/2025	667 700	(4 904)	(0,39)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	11 000	88	0,01
À recevoir	CPTFEMU	2,500	15/01/2025	68 100	492	0,04
					€ (12 574)	(0,99)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					€ (8 849)	(0,70)

⁽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.

Tableau des investissements Fonds Euro Income 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 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	3,380 %	31/07/2023	2 700	€ (9)	€ (12)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	2 700	(9)	(7)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	2 800	(17)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	2 800	(17)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,060	14/07/2023	1 000	(7)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,360	14/07/2023	1 000	(7)	(2)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	2 300	(7)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	2 300	(7)	(2)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	1 700	(11)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	1 700	(11)	0	0,00
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	1 100	(3)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	1 100	(3)	(5)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	1 300	(3)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	1 300	(3)	(4)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	2 000	(13)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	2 000	(13)	0	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,100	31/08/2023	8 500	(58)	(11)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	31/08/2023	8 500	(58)	(79)	(0,02)
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	2 300	(7)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	2 300	(7)	(10)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	1 300	(3)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	1 300	(3)	(4)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	2 000	(7)	(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	10/07/2023	2 000	(7)	(1)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,250	20/07/2023	2 900	(9)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	2 900	(9)	(11)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	2 300	(7)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	2 300	(7)	(2)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	2 000	(6)	(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	10/07/2023	2 000	(6)	(1)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	2 200	(7)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	2 200	(7)	(9)	0,00
							€ (348)	€ (193)	(0,02)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
JPM	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,00 % échéance 01/07/2053	\$ 93,281	06/07/2023	1 800	€ (7)	€ (2)	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
GST	ADLER Real Estate AG	5,000 %	20/12/2026	€ 1 200	€ (6)	€ (265)	€ (271)	(0,02)
JPM	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	5,000	20/12/2023	4 600	0	36	36	0,00
					€ (6)	€ (229)	€ (235)	(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
BOA	07/2023	€ 5 623	\$ 6 138	€ 8	€ (5)	€ 3	0,00
	07/2023	KRW 240 525	184	1	0	1	0,00
	08/2023	€ 13 124	AUD 21 374	0	(95)	(95)	(0,01)
	09/2023	TWD 1 183	\$ 39	1	0	1	0,00
	09/2023	\$ 3 319	IDR 49 689 442	0	(17)	(17)	0,00
	09/2023	1 493	KRW 1 891 572	0	(47)	(47)	0,00
BPS	07/2023	€ 284 621	\$ 311 765	1 184	(44)	1 140	0,09
	07/2023	KRW 36 599	28	0	0	0	0,00
	08/2023	CNH 729	106	5	0	5	0,00
	08/2023	£ 488	€ 567	0	0	0	0,00
	08/2023	KRW 2 395 712	\$ 1 827	6	0	6	0,00
	08/2023	TWD 592	19	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 299 733	€ 273 170	0	(1 187)	(1 187)	(0,09)
	08/2023	1 496	INR 122 911	0	0	0	0,00
BRC	07/2023	¥ 9 880 000	€ 70 570	7 915	0	7 915	0,64
	07/2023	KRW 243 065	\$ 186	1	0	1	0,00
	08/2023	€ 966	£ 835	5	0	5	0,00
	08/2023	¥ 88 300	€ 602	39	0	39	0,00
CBK	07/2023	€ 4 861	\$ 5 271	0	(30)	(30)	0,00
	08/2023	CNH 216	31	1	0	1	0,00
	08/2023	£ 1 340	€ 1 532	0	(27)	(27)	0,00
	08/2023	TWD 570	\$ 19	0	0	0	0,00
	09/2023	KRW 242 283	187	3	0	3	0,00
DUB	07/2023	€ 5 342	5 733	0	(87)	(87)	(0,01)
	07/2023	\$ 11 784	BRL 63 851	1 328	0	1 328	0,11
	08/2023	€ 3 246	NZD 5 650	0	(81)	(81)	(0,01)
	10/2023	\$ 119	ZAR 2 174	0	(5)	(5)	0,00
GLM	07/2023	BRL 64 053	\$ 13 266	0	(9)	(9)	0,00
	07/2023	KRW 95 417	73	0	0	0	0,00
	08/2023	€ 6 209	NOK 71 805	0	(70)	(70)	(0,01)
	08/2023	KRW 1 145 553	\$ 871	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 2 306	INR 189 439	0	0	0	0,00
	09/2023	13 266	BRL 64 763	7	0	7	0,00
JPM	07/2023	DKK 997	€ 134	0	0	0	0,00
	07/2023	€ 134	DKK 996	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 15 387	€ 14 269	165	0	165	0,01
	08/2023	DKK 996	134	0	0	0	0,00
	08/2023	€ 2 760	£ 2 368	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	1 928	¥ 281 099	0	(138)	(138)	(0,01)
	08/2023	£ 33 377	€ 38 309	0	(510)	(510)	(0,04)
	08/2023	KRW 201 838	\$ 153	0	0	0	0,00
	09/2023	INR 10 511	128	0	0	0	0,00
	09/2023	KRW 672 307	517	4	0	4	0,00
	09/2023	\$ 1 384	IDR 20 816 293	0	(1)	(1)	0,00
	10/2023	MXN 19 151	\$ 1 091	0	(4)	(4)	0,00
	12/2023	\$ 1 571	INR 129 643	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07/2023	€ 2 676	\$ 2 930	10	0	10	0,00
	08/2023	2 583	£ 2 222	1	0	1	0,00
	08/2023	10 885	¥ 1 585 563	0	(784)	(784)	(0,06)
	09/2023	\$ 2 749	KRW 3 506 427	0	(70)	(70)	(0,01)
MYI	07/2023	€ 4 383	\$ 4 796	13	0	13	0,00
	07/2023	IDR 13 098 728	876	2	0	2	0,00
	07/2023	\$ 11 788	€ 11 030	225	0	225	0,02
	07/2023	872	IDR 13 098 728	2	0	2	0,00
	08/2023	£ 1 180	€ 1 352	0	(21)	(21)	0,00
	08/2023	TWD 637	\$ 21	1	0	1	0,00
	09/2023	INR 2 270	28	0	0	0	0,00
	09/2023	KRW 1 301 348	1 002	9	0	9	0,00
	09/2023	\$ 876	IDR 13 110 114	0	(5)	(5)	0,00
	09/2023	3 079	KRW 3 940 658	0	(69)	(69)	(0,01)
RBC	07/2023	7 500	MXN 144 318	822	0	822	0,06
	08/2023	1 216	21 068	2	0	2	0,00
SCX	08/2023	£ 52 923	€ 60 607	0	(945)	(945)	(0,07)
	08/2023	NZD 871	484	0	(4)	(4)	0,00
	09/2023	INR 6 574	\$ 80	0	0	0	0,00
	09/2023	KRW 239 131	185	3	0	3	0,00
	09/2023	TWD 988	32	1	0	1	0,00
	09/2023	\$ 2 050	IDR 30 486 750	0	(23)	(23)	0,00
SOG	07/2023	299 994	€ 278 873	3 901	0	3 901	0,31
SSB	07/2023	KRW 177 793	\$ 136	1	0	1	0,00
	09/2023	\$ 8 202	BRL 41 580	293	0	293	0,02
	12/2023	160	INR 13 206	0	0	0	0,00
UAG	08/2023	NZD 4 599	€ 2 556	0	(21)	(21)	0,00
				€ 15 959	€ (4 306)	€ 11 653	0,93
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						€ 11 223	0,89
Total des Investissements						€ 1 639 890	129,93
Autres actifs et passifs à court terme						€ (377 720)	(29,93)
Actifs nets						€ 1 262 170	100,00

Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond 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) 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) 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
Corestate Capital Holding S.A.	15,000 %	31/07/2023	06/12/2022	€ 700	€ 707	0,06
Deutsche Bank AG	2,129	24/11/2026	11/01/2023	2 350	2 285	0,18
Deutsche Bank AG	3,035	28/05/2032	29/07/2021	173	144	0,01
				€ 3 223	€ 3 136	0,25

- (g) Un titre d'une juste valeur globale de 9 079 € (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 247 € (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 44 941 € (31 décembre 2022 : 41 642 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 2 241 € (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	€ 1 388 755	€ 1 008	€ 1 389 763
Fonds d'investissement	15 508	108 537	0	124 045
Contrats de mise en pension	0	122 674	0	122 674
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	2 728	680	0	3 408
Totaux	€ 18 236	€ 1 620 646	€ 1 008	€ 1 639 890

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 30 juin 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
MYI	1,500 %	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (3 636)	€ (3 643)	(0,29)
	1,500	13/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(5 209)	(5 213)	(0,41)
Total des Contrats de prise en pension					€ (8 856)	(0,70)

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	€ (188)	€ 247	€ 59	€ 149	€ (272)	€ (123)
BPS	(38)	60	22	275	(290)	(15)
BRC	7 947	(7 727)	220	175	0	175
CBK	(53)	0	(53)	(16)	0	(16)
DUB	1 155	(1 237)	(82)	S/O	S/O	S/O
FAR	(90)	0	(90)	S/O	S/O	S/O
GLM	(92)	18	(74)	(3 563)	3 382	(181)
GST	(271)	321	50	(289)	328	39
JPM	(474)	321	(153)	(2 314)	1 752	(562)
MBC	(843)	742	(101)	3 869	(3 429)	440
MYC	(17)	0	(17)	S/O	S/O	S/O
MYI	157	(247)	(90)	(128)	0	(128)
RBC	824	(910)	(86)	(168)	0	(168)
RYL	S/O	S/O	S/O	83	0	83
SCX	(968)	532	(436)	(42)	0	(42)
SOG	3 901	(2 878)	1 023	S/O	S/O	S/O
SSB	294	(257)	37	428	(272)	156
UAG	(21)	(238)	(259)	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	80,93	60,94
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	29,18	19,96
Autres valeurs mobilières	S/O	0,44
Fonds d'investissement	9,83	9,96
Contrats de mise en pension	9,72	8,90
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,08	0,20
Instruments financiers dérivés compensés	(0,70)	(0,20)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,89	(0,11)
Contrats de prise en pension	(0,70)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	1,06	2,26
Obligations et billets privés	26,02	43,78
Obligations et billets convertibles	0,09	0,11
Agences du gouvernement américain	34,32	6,78
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	18,68	3,46
Titres adossés à des actifs	15,81	11,18
Émissions souveraines	0,30	1,15
Instruments à court terme	13,83	12,62
Fonds d'investissement	9,83	9,96
Contrats de mise en pension	9,72	8,90
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,08	0,20
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	S/O
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	0,30	0,16
Swaps de taux d'intérêt	(0,99)	(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	(0,02)	(0,24)
Options sur titres	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,02)	(0,02)
Contrats de change à terme	0,93	0,15
Autres actifs et passifs à court terme	(29,93)	(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	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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											
AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % éch. 06/02/2027	400	€ 398	0,09	SK Hynix, Inc. 1,000 % éch. 19/01/2024	\$ 200	€ 178	0,04	Pierpont BTL PLC 0,000 % éch. 21/09/2054	£ 300	€ 349	0,08
AXA Bank Europe SCF 3,000 % éch. 03/11/2026	900	881	0,20			277	0,06	Precise Mortgage Funding PLC 6,065 % éch. 12/12/2055	168	196	0,04
Banco BPM SpA 3,750 % éch. 27/06/2028	300	299	0,07	Total des Obligations et billets privés		14 360	3,19	Primrose Residential DAC 4,189 % éch. 24/03/2061	€ 317	315	0,07
Bank of Montreal 1,000 % éch. 05/04/2026	800	740	0,16	AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				4,439 % éch. 24/10/2061	519	514	0,11
Barclays PLC 3,125 % éch. 17/01/2024	£ 1 000	1 144	0,25	Fannie Mae 4,560 % éch. 01/08/2036	1	1	0,00	Ripon Mortgages PLC 5,491 % éch. 28/08/2056	£ 0	0	0,00
Coventry Building Society 2,625 % éch. 07/12/2026	€ 100	96	0,02	5,036 % éch. 25/07/2037	5	4	0,00	RMAC Securities PLC 5,134 % éch. 12/06/2044	190	212	0,05
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025	1 100	1 077	0,24	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 3,500 % éch. 01/07/2048	469	397	0,09	Shamrock Residential DAC 4,289 % éch. 24/12/2059	€ 144	143	0,03
Union européenne 0,700 % éch. 06/07/2051	1 000	557	0,12	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % éch. 01/08/2053	18 150	15 627	3,47	Stratton Mortgage Funding PLC 5,765 % éch. 12/03/2052	£ 189	219	0,05
Fédération des Caisses Desjardins du Québec 2,000 % éch. 31/08/2026	900	852	0,19	4,500 % éch. 01/08/2053	16 100	14 195	3,15	5,792 % éch. 25/09/2051	274	318	0,07
3,250 % éch. 18/04/2028	1 600	1 573	0,35	5,000 % éch. 01/08/2053	7 400	6 651	1,48	Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,646 % éch. 19/07/2035	\$ 11	10	0,00
Hamburg Commercial Bank AG 4,875 % éch. 17/03/2025	150	150	0,03	OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				Thornburg Mortgage Securities Trust 5,790 % éch. 25/09/2043	18	15	0,00
Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 12	1	0,00	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d) 0,125 % éch. 15/07/2024	5 110	4 544	1,01	Towd Point Mortgage Funding PLC 6,097 % éch. 20/05/2045	£ 711	826	0,18
1,000 % éch. 01/10/2053	0	0	0,00	0,125 % éch. 15/01/2032	2 517	2 032	0,45	Tower Bridge Funding PLC 5,629 % éch. 20/12/2063	174	201	0,05
1,500 % éch. 01/10/2050	3	0	0,00	0,500 % éch. 15/04/2024	722	646	0,14	Tudor Rose Mortgages 5,509 % éch. 20/06/2048	209	242	0,05
2,000 % éch. 01/10/2050	16	2	0,00	0,500 % éch. 15/01/2028	1 599	1 371	0,31	Twin Bridges PLC 5,635 % éch. 01/12/2055	640	739	0,17
Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % éch. 23/05/2059	€ 1 400	1 333	0,30	0,625 % éch. 15/01/2024	8 711	7 849	1,74	TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS			
National Bank of Canada 3,500 % éch. 25/04/2028	100	100	0,02	1,625 % éch. 15/10/2027	11 879	10 731	2,39	Accunia European CLO DAC 4,107 % éch. 15/10/2030	€ 102	101	0,02
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 0	0	0,00	TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				4,127 % éch. 15/07/2030	497	490	0,11
1,500 % éch. 01/10/2050	0	0	0,00	Alba PLC 3,686 % éch. 15/12/2038	€ 195	186	0,04	Ares European CLO DAC 3,837 % éch. 15/10/2030	199	195	0,04
2,000 % éch. 01/10/2047	0	0	0,00	Atlas Funding PLC 5,937 % éch. 20/01/2061	£ 792	924	0,21	Bain Capital Euro CLO DAC 3,940 % éch. 20/01/2032	199	194	0,04
2,000 % éch. 01/10/2050	19	2	0,00	Avon Finance PLC 5,809 % éch. 20/09/2048	479	558	0,12	BBVA Consumer Auto 0,270 % éch. 20/07/2031	53	51	0,01
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	0	0	0,00	Barley Hill PLC 5,824 % éch. 27/08/2058	101	118	0,03	Black Diamond CLO DAC 4,060 % éch. 20/01/2032	418	413	0,09
1,000 % éch. 01/10/2053	10	1	0,00	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 4,635 % éch. 25/07/2033	\$ 3	3	0,00	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 1,050 % éch. 15/01/2031	99	92	0,02
1,500 % éch. 01/10/2047	1	0	0,00	Brants Bridge PLC 0,000 % éch. 14/06/2066	£ 2 000	2 319	0,52	4,087 % éch. 15/01/2033	400	390	0,09
1,500 % éch. 01/10/2050	0	0	0,00	(a)				BNPP AM Euro CLO DAC 3,827 % éch. 15/10/2031	246	241	0,05
1,500 % éch. 01/10/2053	0	0	0,00	Canada Square Funding PLC 5,316 % éch. 17/01/2059	1 954	2 264	0,50	Bumper BE NV/S.A. 4,139 % éch. 23/10/2031	699	701	0,16
2,000 % éch. 01/10/2047	0	0	0,00	5,682 % éch. 17/06/2058	234	271	0,06	Cairn CLO DAC 3,957 % éch. 15/10/2031	600	588	0,13
2,000 % éch. 01/10/2050	22	2	0,00	5,852 % éch. 17/06/2058	315	365	0,08	4,051 % éch. 25/07/2029	157	157	0,03
2,000 % éch. 01/10/2053	0	0	0,00	Charter Mortgage Funding PLC 5,327 % éch. 16/01/2057	65	76	0,02	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,073 % éch. 15/11/2031	300	294	0,07
3,000 % éch. 01/10/2053	0	0	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC 4,148 % éch. 15/12/2029	830	831	0,18
5,000 % éch. 01/10/2053	10	1	0,00	4,260 % éch. 25/07/2033	\$ 5	4	0,00	Ginkgo Sales Finance 4,113 % éch. 25/11/2049	272	272	0,06
Permanent TSB Group Holdings PLC 5,250 % éch. 30/06/2025	€ 100	99	0,02	Dilosk RMBS DAC 4,070 % éch. 20/07/2061	€ 400	400	0,09	Harvest CLO DAC 3,937 % éch. 15/07/2031	300	293	0,07
Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 0	0	0,00	4,133 % éch. 20/02/2060	0	0	0,00	Jubilee CLO DAC 4,047 % éch. 15/01/2030	1 196	1 186	0,26
1,500 % éch. 01/10/2053	0	0	0,00	Domt BV 4,027 % éch. 15/04/2054	810	807	0,18	Laurelin DAC 3,920 % éch. 20/10/2031	400	393	0,09
2,000 % éch. 01/10/2047	0	0	0,00	4,203 % éch. 15/11/2052	823	823	0,18	Madison Park Euro Funding DAC 3,927 % éch. 15/01/2032	400	392	0,09
3,000 % éch. 01/10/2053	0	0	0,00	Dutch Property Finance BV 4,168 % éch. 28/04/2064	197	198	0,04	Man GLG Euro CLO DAC 3,857 % éch. 15/10/2030	293	288	0,06
SLM Student Loan Trust 4,076 % éch. 15/12/2033	€ 435	402	0,09	4,492 % éch. 28/04/2050	184	181	0,04	4,047 % éch. 15/01/2030	440	434	0,10
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,267 % éch. 18/06/2026	900	805	0,18	Eurohome UK Mortgages PLC 5,137 % éch. 15/06/2044	£ 121	136	0,03	NovaStar Mortgage Funding Trust 5,855 % éch. 25/01/2036	\$ 255	231	0,05
3,602 % éch. 16/02/2026	100	99	0,02	Great Hall Mortgages PLC 3,677 % éch. 18/03/2039	€ 36	36	0,01	Oak Hill European Credit Partners DAC 3,930 % éch. 20/01/2032	€ 2 909	2 859	0,64
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % éch. 06/04/2026	1 800	1 778	0,40	5,644 % éch. 18/06/2039	\$ 15	14	0,00	Palmer Square European Loan Funding DAC 5,025 % éch. 12/04/2032	286	288	0,06
Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026	1 200	1 198	0,27	Jubilee Place BV 4,177 % éch. 17/10/2057	€ 89	89	0,02				
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,625 % éch. 15/02/2026	100	98	0,02	Landmark Mortgage Securities PLC 5,222 % éch. 17/06/2039	£ 171	192	0,04				
UniCredit SpA 3,375 % éch. 31/01/2027	400	395	0,09	London Wall Mortgage Capital PLC 5,452 % éch. 15/05/2051	669	775	0,17				
		14 083	3,13	Ludgate Funding PLC 4,590 % éch. 01/01/2061	75	83	0,02				
INDUSTRIE				5,068 % éch. 01/12/2060	192	213	0,05				
Nokia Oyj 4,375 % éch. 21/08/2031	100	99	0,02	Newgate Funding PLC 4,126 % éch. 15/12/2050	€ 675	650	0,15				

Tableau des investissements Fonds Euro Long Average Duration 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 %	20/12/2028	€ 100	€ 1	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 recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250 %	20/09/2053	£ 110	€ 8	0,00
À payer ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	130	(3)	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2029	¥ 147 000	(10)	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	1 320 000	(57)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,435	20/06/2029	103 000	(5)	0,00
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,880	25/01/2052	\$ 800	(206)	(0,05)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,865	13/02/2054	1 000	6	0,00
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,085	13/02/2034	1 100	(11)	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	20/12/2053	2 600	(9)	0,00
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2033	3 300	(8)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/07/2023	800	(3)	0,00
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	€ 21 300	(65)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,750	20/09/2043	8 300	101	0,02
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	100	0	0,00
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	4 800	(11)	0,00
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2038	34 500	77	0,01
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	34 800	139	0,03
À recevoir	CPTFEMU	3,340	15/08/2027	4 500	(12)	0,00
					€ (69)	(0,02)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					€ (68)	(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.

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 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,420 %	21/09/2023	7 000	€ (37)	€ (27)	(0,01)
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	12/09/2023	7 100	(19)	(8)	0,00
							€ (56)	€ (35)	(0,01)

⁽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	07/2023	€	1 522	DKK	11 333	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	08/2023	£	100	€	114	0	(2)	(2)	0,00
BPS	08/2023	\$	20	CNY	140	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	CNH	1 127	\$	164	8	0	8	0,00
BRC	08/2023	€	144	£	123	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023		230	\$	248	0	(4)	(4)	0,00
	08/2023	£	2 417	€	2 810	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$	18	CNH	127	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023		24	CNY	165	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023		399	€	364	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	¥	13 200		90	6	0	6	0,00
	08/2023	\$	1 219		1 122	7	0	7	0,00
CBK	09/2023	ILS	52	\$	15	0	0	0	0,00
	08/2023	\$	984	€	899	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07/2023	DKK	11 425		1 534	0	0	0	0,00
	08/2023	€	1 252	£	1 091	16	0	16	0,00
	08/2023		1 167	¥	180 078	0	(20)	(20)	(0,01)
	08/2023		794	\$	865	1	(4)	(3)	0,00
	08/2023	£	1 549	€	1 777	0	(24)	(24)	(0,01)
	08/2023	\$	15	CNH	102	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023		25	CNY	174	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023		10 655	€	9 734	1	(13)	(12)	0,00
	09/2023	ILS	50	\$	14	1	0	1	0,00
	08/2023	€	1 502	¥	218 734	0	(109)	(109)	(0,02)
MYI	08/2023	\$	7 231	€	6 553	0	(61)	(61)	(0,01)
	08/2023	€	943	¥	148 200	1	0	1	0,00
RYL	08/2023	£	86	€	99	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	\$	3 830		3 487	0	(16)	(16)	0,00
	08/2023	£	296		340	0	(4)	(4)	0,00
SCX	08/2023	¥	88 100		596	36	0	36	0,01
	08/2023	\$	600		546	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	€	122	£	105	0	0	0	0,00
UAG	08/2023	£	3 391	€	3 898	0	(46)	(46)	(0,01)
	08/2023	\$	68	CNY	463	0	(3)	(3)	0,00
	09/2023	ILS	43	\$	12	0	0	0	0,00
						€ 77	€ (319)	€ (242)	(0,05)
Total des Instruments financiers dérivés hors cote								€ (277)	(0,06)
Total des Investissements								€ 460 799	102,41
Autres actifs et passifs à court terme								€ (10 834)	(2,41)
Actifs nets								€ 449 965	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.
- (e) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 6 017 € (31 décembre 2022 : 4 192 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 0 € (31 décembre 2022 : 190 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	€ 441 939	€ 4	€ 441 943
Fonds d'investissement	97	11 063	0	11 160
Contrats de mise en pension	0	7 333	0	7 333
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	612	(249)	0	363
Totaux	€ 709	€ 460 086	€ 4	€ 460 799

Tableau des investissements Fonds Euro Long Average Duration 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	€ 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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	€ (30)	€ 0	€ (30)	€ (20)	€ 0	€ (20)
BPS	(9)	0	(9)	(57)	190	133
BRC	13	0	13	(84)	0	(84)
CBK	(1)	0	(1)	(44)	0	(44)
GLM	S/O	S/O	S/O	(46)	0	(46)
GST	S/O	S/O	S/O	(68)	0	(68)
JPM	(44)	0	(44)	(85)	0	(85)
MBC	(170)	0	(170)	3	0	3
MYC	S/O	S/O	S/O	4	0	4
MYI	(17)	0	(17)	33	0	33
RBC	S/O	S/O	S/O	27	0	27
RYL	30	0	30	(3)	0	(3)
SCX	(49)	0	(49)	(8)	0	(8)
SSB	S/O	S/O	S/O	167	0	167
UAG	S/O	S/O	S/O	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	91,35	87,44
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	6,87	7,03
Fonds d'investissement	2,48	4,49
Contrats de mise en pension	1,63	1,36
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,16	(6,40)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,02)	(7,11)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,06)	(0,16)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	3,19	7,89
Agences du gouvernement américain	8,19	5,28
Obligations du Trésor américain	6,04	3,51
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	3,55	12,44
Titres adossés à des actifs	3,06	10,28
Émissions souveraines	73,90	53,89
Instruments à court terme	0,29	1,18
Fonds d'investissement	2,48	4,49
Contrats de mise en pension	1,63	1,36
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,16	(6,40)
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	S/O
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	(0,02)	(7,02)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	S/O	0,33

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Options vendues		
Options de change	S/O	(0,04)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,01)	(0,74)
Contrats de change à terme	(0,05)	0,29
Autres actifs et passifs à court terme	(2,41)	13,35
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Euro Short-Term 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	\$ 1 000	€ 4	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 ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000%	20/09/2028	€ 40 200	€ 60	0,03
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	25 000	20	0,01
					€ 80	0,04
Total des Instruments financiers dérivés compensés					€ 84	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.

⁽³⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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	07/2023	€ 242	\$ 264	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	07/2023	\$ 105	€ 97	1	0	1	0,00
	08/2023	AUD 3 582	2 199	16	0	16	0,01
BPS	07/2023	€ 26 418	\$ 28 934	110	(7)	103	0,05
	07/2023	\$ 489	€ 453	5	0	5	0,00
	08/2023	27 887	25 416	0	(110)	(110)	(0,05)
BRC	07/2023	€ 1 864	£ 1 603	5	(1)	4	0,00
	07/2023	£ 6 407	€ 7 419	0	(47)	(47)	(0,02)
	08/2023	¥ 8 000	55	4	0	4	0,00
CBK	09/2023	ILS 21	\$ 6	0	0	0	0,00
	07/2023	€ 1 766	£ 1 511	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	305	261	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07/2023	1 210	\$ 1 299	0	(20)	(20)	(0,01)
	08/2023	178	¥ 25 915	0	(13)	(13)	(0,01)
	09/2023	ILS 20	\$ 6	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	€ 45 426	£ 39 222	278	0	278	0,13
	07/2023	£ 20 146	€ 23 249	0	(226)	(226)	(0,11)
	07/2023	¥ 1 200 000	8 247	614	0	614	0,30
MYI	08/2023	€ 1 004	¥ 146 175	0	(72)	(72)	(0,03)
	08/2023	£ 38 910	€ 45 010	0	(274)	(274)	(0,13)
	07/2023	€ 383	\$ 419	1	0	1	0,00
RYL	07/2023	\$ 491	€ 459	9	0	9	0,00
	07/2023	DKK 5 200	698	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 29 307	27 244	381	0	381	0,18
UAG	07/2023	€ 2 039	¥ 300 000	0	(131)	(131)	(0,06)
	07/2023	£ 16 260	€ 18 694	0	(254)	(254)	(0,12)
	07/2023	¥ 740 000	5 192	496	0	496	0,23
				€ 1 920	€ (1 162)	€ 758	0,36

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ 758 0,36

Total des Investissements

€ 210 734 98,77

Autres actifs et passifs à court terme

€ 2 625 1,23

Actifs nets

€ 213 359 100,00

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) 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	21/10/2022 - 24/10/2022	\$ 1 434	\$ 1 322	0,62

Un montant en numéraire de 4 603 € (31 décembre 2022 : 6 376 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 10 € (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	€ 199 083	€ 0	€ 199 083
Contrats de mise en pension	0	9 531	0	9 531
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	1 278	842	0	2 120
Totaux	€ 1 278	€ 209 456	€ 0	€ 210 734

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	€ 57	€ 0	€ 57
BPS	(2)	0	(2)	(9)	0	(9)
BRC	(39)	0	(39)	(9)	0	(9)
CBK	(5)	0	(5)	77	0	77
JPM	(34)	10	(24)	31	0	31
MBC	320	(510)	(190)	371	(230)	141
MYI	10	0	10	(25)	0	(25)
RBC	S/O	S/O	S/O	(190)	20	(170)
RYL	(1)	0	(1)	S/O	S/O	S/O
SCX	S/O	S/O	S/O	1 972	(1 890)	82
SOG	381	(430)	(49)	S/O	S/O	S/O
UAG	111	0	111	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	87,45	82,88
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	5,85	10,78
Contrats de mise en pension	4,47	3,99
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,60	0,70
Instruments financiers dérivés compensés	0,04	(0,45)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,36	0,63

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	46,34	56,35
Agences du gouvernement américain	1,19	1,90
Obligations du Trésor américain	4,79	S/O
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	18,43	14,24
Titres adossés à des actifs	12,27	6,88
Émissions souveraines	4,84	3,88
Instruments à court terme	5,44	10,41
Contrats de mise en pension	4,47	3,99
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,60	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	0,04	(0,45)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Contrats de change à terme	0,36	0,63
Autres actifs et passifs à court terme	1,23	1,47
Actifs nets	100,00	100,00

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
Summer BC Holdco SARL 5,750 % éch. 31/10/2026	€ 1 850	€ 1 650	0,73	SUÈDE				Travis Perkins PLC 3,750 % éch. 17/02/2026	600	629	0,28
Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % éch. 15/11/2033	\$ 500	389	0,17	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % éch. 15/01/2030	€ 4 000	€ 3 679	1,64
Trafigura Funding S.A. 3,875 % éch. 02/02/2026	€ 700	660	0,29	Akellus Residential Property AB 2,249 % éch. 17/05/2081	€ 1 200	€ 990	0,44	Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % éch. 31/01/2031	€ 700	577	0,26
		15 665	6,97	Dometic Group AB 2,000 % éch. 29/09/2028	900	729	0,33	Zenith Finco PLC 6,500 % éch. 30/06/2027	£ 800	712	0,32
Total Luxembourg		15 694	6,99	Intrum AB 4,875 % éch. 15/08/2025	900	748	0,33			34 976	15,57
MULTINATIONALES				9,250 % éch. 15/03/2028 (h)	1 200	1 018	0,45	CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Verisure Holding AB 3,250 % éch. 15/02/2027	1 500	1 336	0,60	Lorca Holdco Ltd. 7,522 % éch. 01/09/2027	€ 2 300	2 229	0,99
Clarios Global LP 4,375 % éch. 15/05/2026	900	861	0,38	3,875 % éch. 15/07/2026	200	188	0,08	Total Royaume-Uni		37 205	16,56
PAYS-BAS				Verisure Midholding AB 5,250 % éch. 15/02/2029	600	522	0,23	ÉTATS-UNIS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Volvo Car AB 4,250 % éch. 31/05/2028	700	674	0,30	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
CTP NV 0,500 % éch. 21/06/2025	1 400	1 248	0,56	Total Suède		6 674	2,97	American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % éch. 01/11/2028	\$ 871	716	0,32
Dufry One BV 2,000 % éch. 15/02/2027	1 200	1 050	0,47	SUISSE				3,700 % éch. 01/04/2028	1 762	1 454	0,65
3,625 % éch. 15/04/2026	CHF 1 500	1 478	0,66	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Avantor Funding, Inc. 3,875 % éch. 01/07/2028	€ 900	827	0,37
Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % éch. 30/06/2029	€ 900	728	0,32	UBS Group AG 6,442 % éch. 11/08/2028	\$ 650	598	0,27	Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % éch. 01/07/2031	\$ 300	274	0,12
IPD 3 BV 8,000 % éch. 15/06/2028	1 100	1 125	0,50	9,016 % éch. 15/11/2033	600	660	0,29	Chemours Co. 4,000 % éch. 15/05/2026	€ 1 400	1 303	0,58
OI European Group BV 6,250 % éch. 15/05/2028	1 000	1 024	0,46	Total Suisse		1 258	0,56	Coty, Inc. 3,875 % éch. 15/04/2026	2 100	2 041	0,91
Q-Park Holding BV 3,500 % éch. 01/02/2025	1 100	1 030	0,46	ROYAUME-UNI				Credit Suisse AG AT1 Claim ^ 800	\$ 800	29	0,01
Sigma Holdco BV 5,750 % éch. 15/05/2026	500	435	0,19	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % éch. 17/06/2031	3 400	2 558	1,14
Summer BidCo BV (9,000 % en numéraire ou 9,750 % de rémunération en nature) 9,000 % éch. 15/11/2025 (b)	242	216	0,10	BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % éch. 30/11/2028	€ 1 800	1 539	0,68	Gap, Inc. 3,875 % éch. 01/10/2031	800	503	0,22
Telefonica Europe BV 7,125 % éch. 23/08/2028 (e)	400	410	0,18	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£ 2 800	2 739	1,22	Graphic Packaging International LLC 2,625 % éch. 01/02/2029	€ 200	176	0,08
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % éch. 31/03/2027	4 100	3 500	1,56	Burford Capital PLC 5,000 % éch. 01/12/2026	1 300	1 383	0,61	IQVIA, Inc. 2,250 % éch. 15/03/2029	800	685	0,30
3,750 % éch. 09/05/2027	100	91	0,04	Gatwick Airport Finance PLC 4,375 % éch. 07/04/2026	1 800	1 913	0,85	Kronos International, Inc. 3,750 % éch. 15/09/2025	1 400	1 281	0,57
7,375 % éch. 15/09/2029	1 100	1 123	0,50	Harbour Energy PLC 5,500 % éch. 15/10/2026	\$ 1 000	844	0,38	Olympus Water U.S. Holding Corp. 3,875 % éch. 01/10/2028	1 700	1 346	0,60
United Group BV 3,625 % éch. 15/02/2028	800	637	0,28	Heathrow Finance PLC 3,875 % éch. 01/03/2027	£ 400	399	0,18	Organon & Co. 2,875 % éch. 30/04/2028	1 800	1 567	0,70
4,000 % éch. 15/11/2027	1 100	905	0,40	4,125 % éch. 01/09/2029	1 114	1 054	0,47	Rio Oil Finance Trust 8,200 % éch. 06/04/2028	\$ 1 372	1 265	0,56
ZF Europe Finance BV 2,000 % éch. 23/02/2026	500	456	0,20	Iceland Bondco PLC 4,375 % éch. 15/05/2028	100	92	0,04	SCIL LLC 9,500 % éch. 15/07/2028 (a)	€ 600	600	0,27
		15 456	6,88	INEOS Finance PLC 2,125 % éch. 15/11/2025	€ 500	470	0,21	Spectrum Brands, Inc. 4,000 % éch. 01/10/2026	2 400	2 310	1,03
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				2,875 % éch. 01/05/2026	500	460	0,20	Standard Industries, Inc. 2,250 % éch. 21/11/2026	2 700	2 405	1,07
Nouryon Finance BV 6,478 % éch. 03/04/2028	944	929	0,41	INEOS Quattro Finance PLC 2,500 % éch. 15/01/2026	2 400	2 156	0,96	Venture Global LNG, Inc. 8,125 % éch. 01/06/2028	\$ 900	839	0,37
Total Pays-Bas		16 385	7,29	Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,500 % éch. 15/01/2026	900	855	0,38	8,375 % éch. 01/06/2031	900	833	0,37
PANAMA				4,500 % éch. 15/07/2028	300	263	0,12	WMG Acquisition Corp. 2,250 % éch. 15/08/2031	€ 1 400	1 115	0,50
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				6,875 % éch. 15/11/2026	500	498	0,22	Total États-Unis		24 127	10,74
Carnival Corp. 10,125 % éch. 01/02/2026	1 800	1 895	0,84	John Lewis PLC 4,250 % éch. 18/12/2034	£ 240	174	0,08	INSTRUMENTS À COURT TERME			
ESPAGNE				6,125 % éch. 21/01/2025	300	337	0,15	BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILITÉ			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Lloyds Banking Group PLC 7,500 % éch. 27/09/2025 (e)(g)	\$ 600	516	0,23	3,052 % éch. 18/08/2023 (c)(d)	680	677	0,30
Aedas Homes Opco SLU 4,000 % éch. 15/08/2026	700	653	0,29	Market Bidco Finco PLC 4,750 % éch. 04/11/2027	€ 1 200	969	0,43	3,070 % éch. 18/08/2023 (c)(d)	1 810	1 803	0,81
Banco Santander S.A. 4,375 % éch. 14/01/2026 (e)(g)	800	672	0,30	5,500 % éch. 04/11/2027	£ 800	728	0,32	3,337 % éch. 07/09/2023 (c)(d)	250	249	0,11
Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % éch. 08/06/2028	700	599	0,27	Marks & Spencer PLC 3,750 % éch. 19/05/2026	1 300	1 367	0,61			2 729	1,22
2,000 % éch. 15/09/2032	1 300	1 026	0,46	PEU Fin PLC 7,250 % éch. 01/07/2028	€ 900	902	0,40	BONS DU TRÉSOR DE L'UNION EUROPÉENNE			
Cellnex Telecom S.A. 1,750 % éch. 23/10/2030	200	162	0,07	Pinnacle Bidco PLC 5,500 % éch. 15/02/2025	500	482	0,21	3,172 % éch. 04/08/2023 (c)(d)	150	150	0,07
Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % éch. 15/10/2028	1 400	1 202	0,54	6,375 % éch. 15/02/2025	£ 2 800	3 116	1,39	3,173 % éch. 04/08/2023 (c)(d)	250	249	0,11
Grifols S.A. 2,250 % éch. 15/11/2027	300	272	0,12	Rolls-Royce PLC 3,375 % éch. 18/06/2026	1 580	1 628	0,72	3,179 % éch. 04/08/2023 (c)(d)	200	199	0,09
3,200 % éch. 01/05/2025	1 300	1 268	0,56	4,625 % éch. 16/02/2026	€ 2 600	2 562	1,14	3,326 % éch. 08/09/2023 (c)(d)	150	149	0,06
Total Espagne		5 854	2,61	Thames Water Kemble Finance PLC 4,625 % éch. 19/05/2026	£ 800	485	0,22			747	0,33

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS				BONS DU TRÉSOR ALLEMAND				FONDS D'INVESTISSEMENT FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
3,094 % éch. 19/07/2023 (c)(d)	€ 5 150	€ 5 142	2,29	3,143 % éch. 19/07/2023 (c)(d)	€ 4 950	€ 4 942	2,20	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	120 900	€ 1 682	5,20
3,096 % éch. 19/07/2023 (c)(d)	1 870	1 867	0,83	Total des Instruments à court terme		16 375	7,29				
3,127 % éch. 02/08/2023 (c)(d)	500	499	0,22	Total des Valeurs mobilières		€ 203 864	90,74	Total des Fonds d'investissement		€ 11 682	5,20
3,135 % éch. 02/08/2023 (c)(d)	450	449	0,20								
		7 957	3,54								

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	3,100 %	30/06/2023	03/07/2023	€ 3 200	Union européenne 3,250 % échéance 04/07/2034	€ (3 250)	€ 3 200	€ 3 201	1,42	
Total des Contrats de mise en pension							€ (3 250)	€ 3 200	€ 3 201	1,42

⁽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 Euro-Bobl septembre	Long	09/2023	146	€ (202)	(0,09)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	11	14	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	1	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Long	09/2023	372	(327)	(0,15)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Court	09/2023	58	124	0,06
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	57	93	0,04
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	27	34	0,01
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	6	6	0,00
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				€ (260)	(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
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20/12/2027	€ 100	€ 11	0,01
United Group BV	5,000	20/12/2027	700	82	0,03
				€ 93	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 iTraxx Crossover 39 à 5 ans	5,000 %	20/06/2028	€ 25 900	€ 396	0,18

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	3,750 %	20/09/2028	£ 1 500	€ 102	0,04		
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	16/09/2023	\$ 6 800	(89)	(0,04)		
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	16/12/2025	3 800	408	0,18		
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	16/12/2030	3 000	508	0,23		
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	800	26	0,01		
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	16/09/2023	6 800	90	0,04		
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	€ 200	(4)	0,00		
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	1 500	(30)	(0,01)		
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	3 300	(19)	(0,01)		
					€ 992	0,44		
Total des Instruments financiers dérivés compensés							€ 1 481	0,66

Tableau des investissements Fonds PIMCO European High Yield Bond 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 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.

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	3,018	20/10/2023	1 300	€ (8)	€ 0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	1 300	(8)	(24)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	1 300	(9)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	1 300	(9)	(23)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	1 300	(8)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	1 300	(8)	(23)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	1 300	(8)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	1 300	(8)	(22)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	1 300	(8)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	1 300	(8)	(25)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	1 300	(9)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	1 300	(8)	(26)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	400	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	400	(3)	(7)	(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	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	2,721	08/04/2024	100	(1)	(2)	0,00
							€ (107)	€ (152)	(0,07)

(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	Deutsche Bank AG	1,000 %	20/06/2027	€ 600	€ (81)	€ 47	€ (34)	(0,01)
GST	EP Infrastructure A/S	5,000	20/06/2028	600	(12)	22	10	0,00
					€ (93)	€ 69	€ (24)	(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	07/2023	CHF	€ 1 347	€ 12	€ 0	€ 12	0,01
	07/2023	€	\$ 270	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	€	£289	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07/2023	\$	€ 146	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	€	\$ 17 259	74	0	74	0,03
	07/2023	\$	€ 150	3	0	3	0,00
BRC	08/2023	€	\$ 18 937	0	(75)	(75)	(0,03)
	07/2023	£	€ 3 346	0	(25)	(25)	(0,01)
MBC	07/2023	€	£ 27 636	170	0	170	0,08
	07/2023	£	€ 11 075	0	(125)	(125)	(0,06)
MYI	08/2023	€	£ 23 890	0	(167)	(167)	(0,07)
	07/2023	€	£ 318	0	(2)	(2)	0,00
SOG	07/2023	\$	€ 570	11	0	11	0,00
	07/2023	€	\$ 17 988	234	0	234	0,10
UAG	07/2023	€	CHF 1 392	4	0	4	0,00
	07/2023	£	€ 8 939	0	(140)	(140)	(0,06)
	08/2023	CHF	€ 1 360	0	(4)	(4)	0,00
				€ 508	€ (541)	€ (33)	(0,01)

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ (209) (0,09)

Total des Investissements

€ 219 758 97,81

Autres actifs et passifs à court terme

€ 4 915 2,19

Actifs nets

€ 224 673 100,00

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) Des titres d'une juste valeur globale de 786 € (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 3 816 € (31 décembre 2022 : 2 986 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 190 € (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	€ 203 379	€ 485	€ 203 864
Fonds d'investissement	0	11 682	0	11 682
Contrats de mise en pension	0	3 200	0	3 200
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(511)	1 523	0	1 012
Totaux	€ (511)	€ 219 784	€ 485	€ 219 758

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	€ 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.

Contrats de prise en pension au 30 juin 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
MY1	1,750 %	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (191)	€ (191)	(0,08)
	2,200	31/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(644)	(646)	(0,29)
Total des Contrats de prise en pension					€ (837)	(0,37)

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	€ (11)	€ 0	€ (11)
BPS	(32)	50	18	(22)	0	(22)
BRC	(25)	0	(25)	80	0	80
CBK	S/O	S/O	S/O	19	0	19
GLM	(152)	0	(152)	(198)	0	(198)
GST	10	0	10	S/O	S/O	S/O
MBC	(122)	0	(122)	230	0	230
MYI	9	0	9	(8)	0	(8)
SCX	S/O	S/O	S/O	207	0	207
SOG	234	(270)	(36)	S/O	S/O	S/O
UAG	(140)	140	0	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	83,73	80,86
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	7,00	8,16
Autres valeurs mobilières	0,01	1,26
Fonds d'investissement	5,20	5,00
Contrats de mise en pension	1,42	2,12
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,12)	(0,40)
Instruments financiers dérivés compensés	0,66	0,74
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,09)	0,17
Contrats de prise en pension	(0,37)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Belgique	0,35	S/O
Îles Caïmans	0,01	0,02
Chine	0,00	0,01
République tchèque	1,07	1,23
Danemark	S/O	1,34
Finlande	0,58	S/O
France	13,31	12,16
Allemagne	9,53	6,94
Irlande	0,78	1,03
Île de Man	S/O	1,03
Italie	7,42	8,16
Japon	0,71	0,97
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,75	1,28
Luxembourg	6,99	8,62
Multinationales	0,38	0,53
Pays-Bas	7,29	6,59
Panama	0,84	0,74
Espagne	2,61	2,40
Suède	2,97	4,04
Suisse	0,56	0,90
Royaume-Uni	16,56	12,74
États-Unis	10,74	8,45
Instruments à court terme	7,29	11,10
Fonds d'investissement	5,20	5,00
Contrats de mise en pension	1,42	2,12
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	0,04	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,18	0,17
Swaps de taux d'intérêt	0,44	0,57
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,07)	(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	2,19	2,09
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO European Short-Term 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
Towd Point Mortgage Funding PLC				Bridgepoint CLO DAC				Silver Arrow Merfina SRL			
5,161 % éch. 20/10/2051	£ 500	€ 577	0,39	4,387 % éch. 15/01/2034	€ 300	€ 296	0,20	4,055 % éch. 20/07/2033	€ 463	€ 464	0,31
5,841 % éch. 20/07/2045	294	343	0,23	Bumper UK Finance PLC				Silver Arrow S.A.			
6,097 % éch. 20/05/2045	640	744	0,50	5,287 % éch. 20/12/2030	£ 193	225	0,15	4,028 % éch. 15/02/2027	21	21	0,01
6,546 % éch. 20/02/2054	562	655	0,44	Carlyle Euro CLO DAC				Tikehau CLO DAC			
Tower Bridge Funding PLC				3,877 % éch. 15/01/2031	€ 398	390	0,26	4,144 % éch. 04/08/2034	600	586	0,40
5,527 % éch. 20/11/2063	719	833	0,56	3,953 % éch. 15/08/2030	453	443	0,30	Toro European CLO DAC			
Trinity Square PLC				4,213 % éch. 15/08/2032	800	782	0,53	3,995 % éch. 12/01/2032	1 200	1 177	0,80
5,316 % éch. 15/07/2059	765	890	0,60	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				4,133 % éch. 15/02/2034	1 000	973	0,66
Tudor Rose Mortgages				3,991 % éch. 25/01/2032	799	782	0,53	Turbo Finance PLC			
5,509 % éch. 20/06/2048	261	303	0,21	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				5,617 % éch. 20/08/2028	£ 83	97	0,07
Twin Bridges PLC				4,073 % éch. 15/11/2031	1 100	1 079	0,73	Voya Euro CLO DAC			
6,115 % éch. 12/12/2054	471	550	0,37	Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC				3,927 % éch. 15/10/2030	€ 288	284	0,19
		27 933	18,89	4,148 % éch. 15/12/2029	215	216	0,15			32 138	21,73
				Compartment VCL							
				4,072 % éch. 21/01/2028	321	322	0,22				
				Contego CLO DAC							
				3,851 % éch. 23/01/2030	499	489	0,33				
				CVC Cordatus Loan Fund DAC							
				3,827 % éch. 15/10/2031	1 800	1 766	1,19				
				4,156 % éch. 15/09/2031	300	294	0,20				
				Dryden Euro CLO DAC							
				3,837 % éch. 15/04/2033	400	391	0,26				
				FCT Pulse France							
				4,163 % éch. 25/01/2035	400	401	0,27				
				Harvest CLO DAC							
				1,040 % éch. 15/07/2031	400	365	0,25				
				3,817 % éch. 15/10/2031	600	586	0,40				
				3,880 % éch. 20/10/2031	1 800	1 763	1,19				
				3,937 % éch. 15/07/2031	700	683	0,46				
				4,027 % éch. 15/01/2032	1 200	1 174	0,79				
				4,250 % éch. 26/06/2030	620	608	0,41				
				Man GLG Euro CLO DAC							
				3,857 % éch. 15/10/2030	293	288	0,19				
				3,987 % éch. 15/10/2032	599	584	0,39				
				Palmer Square European Loan Funding DAC							
				3,897 % éch. 15/10/2031	1 032	1 011	0,68				
				3,907 % éch. 15/07/2031	875	855	0,58				
				4,227 % éch. 15/10/2031	1 223	1 205	0,82				
				PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment							
				4,139 % éch. 26/11/2030	366	366	0,25				
				Red & Black Auto Lease France							
				4,093 % éch. 27/06/2035	400	400	0,27				
				Sculptor European CLO DAC							
				3,916 % éch. 14/01/2032	700	688	0,47				
				Segovia European CLO DAC							
				3,945 % éch. 18/01/2031	176	173	0,12				
				4,080 % éch. 20/07/2032	800	780	0,53				

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
1,300 % éch. 15/05/2028 (b)	857	840	0,57
1,400 % éch. 26/05/2025 (b)	10 425	10 323	6,98
République d'Allemagne			
4,250 % éch. 04/07/2039	300	369	0,25
Obligation internationale du gouvernement slovène			
1,175 % éch. 13/02/2062	1 300	735	0,50
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen			
0,000 % éch. 16/09/2025 (a)	500	461	0,31
Obligation internationale du gouvernement espagnol			
2,350 % éch. 30/07/2033	912	832	0,56
3,550 % éch. 31/10/2033	590	595	0,40
Bon du Trésor britannique			
0,875 % éch. 31/01/2046	£ 1 100	632	0,43
		14 787	10,00

ACTIONS

TITRES PRIVILÉGIÉS			
Nationwide Building Society			
10,250 %	3 504	470	0,32
Total des Valeurs mobilières	€	145 291	98,25

FONDS D'INVESTISSEMENT FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE

PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)	122 900	11 875	8,03
Total des Fonds d'investissement	€	11 875	8,03

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 322	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	€ (301)	€ 295	€ 295	0,20
Total des Contrats de mise en pension						€ (301)	€ 295	€ 295	0,20

⁽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 septembre	Long	09/2023	332	€ (503)	(0,34)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	5	(5)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	167	183	0,12
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	18	(37)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Long	09/2023	22	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Long	09/2023	196	(114)	(0,08)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	64	(167)	(0,11)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	183	329	0,22
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	151	(243)	(0,16)

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 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	160	€ 178	0,12
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Court	09/2023	20	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	3	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	8	8	0,01
				€ (373)	(0,25)

OPTIONS VENDUES**OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 113,000	21/07/2023	26	€ (17)	€ (27)	(0,02)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					€ (400)	(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 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 37 à 5 ans	(5,000) %	20/06/2027	€ 3 800	€ (238)	(0,16)
Indice iTraxx Europe Main 39 à 5 ans	(1,000)	20/06/2028	16 800	(153)	(0,10)
				€ (391)	(0,26)

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-40 à 5 ans	1,000 %	20/06/2028	\$ 1 800	€ 17	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 ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250 %	20/09/2053	£ 900	€ 73	0,05
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2029	¥ 888 000	(65)	(0,04)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,435	20/06/2029	312 000	(14)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,880	25/01/2052	\$ 1 800	(463)	(0,31)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,865	13/02/2054	2 700	57	0,04
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,085	13/02/2034	5 000	(81)	(0,06)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	20/12/2053	3 300	(14)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2033	7 500	(64)	(0,04)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,250	20/12/2025	11 300	62	0,04
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/07/2023	1 800	(6)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 3 mois	0,550	10/08/2024	€ 800	(33)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	0,819	19/12/2034	6 800	(509)	(0,34)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	0,854	19/12/2039	3 300	(443)	(0,30)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	1,700	15/03/2073	300	34	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	5 400	(21)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	700	(14)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,804	19/05/2033	2 700	37	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	7 700	(27)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	17 500	(2)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	43 600	(22)	(0,02)
À payer	CPTFEMU	1,380	15/03/2031	700	(130)	(0,09)
À payer	CPTFEMU	3,520	15/09/2024	300	(3)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,720	15/09/2024	700	(4)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,850	15/09/2024	500	(3)	0,00
					€ (1 655)	(1,12)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					€ (2 029)	(1,37)

⁽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.

Tableau des investissements Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (suite)

- (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.

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	3,750 %	12/09/2023	9 900	€ (26)	€ (11)	(0,01)
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,420	21/09/2023	9 300	(48)	(36)	(0,02)
MYC	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)	(141)	(0,09)
	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)	(157)	(0,11)
							€ (768)	€ (345)	(0,23)

⁽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	07/2023	DKK 18 593	€ 2 497	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	07/2023	£ 105	123	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 936	868	10	0	10	0,01
BPS	07/2023	€ 21 116	\$ 23 142	97	(2)	95	0,06
	08/2023	\$ 195	CNH 1 344	0	(8)	(8)	(0,01)
	08/2023	20 621	€ 18 793	0	(82)	(82)	(0,05)
BRC	07/2023	€ 6 035	DKK 44 940	0	0	0	0,00
	07/2023	215	£ 184	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	£ 3 591	€ 4 158	0	(26)	(26)	(0,02)
CBK	08/2023	DKK 44 928	6 035	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	€ 1 797	DKK 13 385	1	0	1	0,00
	07/2023	446	£ 381	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07/2023	948	\$ 1 017	0	(16)	(16)	(0,01)
	07/2023	DKK 62 274	€ 8 362	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	€ 1 233	DKK 9 183	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	303	¥ 45 165	0	(17)	(17)	(0,01)
	08/2023	DKK 9 180	€ 1 233	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 156	CNH 1 079	0	(7)	(7)	0,00
MYI	09/2023	ILS 17	\$ 5	0	0	0	0,00
	07/2023	€ 1 631	DKK 12 150	1	0	1	0,00
	07/2023	27 309	£ 23 580	167	0	167	0,11
RBC	07/2023	1 188	¥ 177 526	0	(62)	(62)	(0,04)
	07/2023	778	\$ 838	0	(9)	(9)	(0,01)
	07/2023	£ 11 326	€ 13 071	0	(127)	(127)	(0,09)
SCX	07/2023	¥ 235 061	1 492	1	0	1	0,00
	08/2023	€ 1 492	¥ 234 398	0	0	0	0,00
	08/2023	£ 23 402	€ 27 071	0	(165)	(165)	(0,11)
SOG	07/2023	€ 163	DKK 1 215	0	0	0	0,00
	07/2023	1 293	\$ 1 403	1	(8)	(7)	0,00
	07/2023	\$ 933	€ 873	18	0	18	0,01
UAG	09/2023	ILS 32	\$ 9	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 300	€ 280	5	0	5	0,00
	08/2023	75	MXN 1 292	0	0	0	0,00
UAG	08/2023	CNH 2 952	\$ 430	21	0	21	0,01
	08/2023	\$ 74	CNH 511	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	23 590	€ 21 929	307	0	307	0,21
	07/2023	£ 9 236	10 618	0	(144)	(144)	(0,10)
				€ 629	€ (682)	€ (53)	(0,04)

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

€ (398) (0,27)

Total des Investissements

€ 154 634 104,57

Autres actifs et passifs à court terme

€ (6 756) (4,57)

Actifs nets

€ 147 878 100,00

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 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) Affilié au Fonds.

(e) Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 2 533 € (31 décembre 2022 : 3 688 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 9 € (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	€ 145 291	€ 0	€ 145 291
Fonds d'investissement	0	11 875	0	11 875
Contrats de mise en pension	0	295	0	295
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(470)	(2 357)	0	(2 827)
Totaux	€ (470)	€ 155 104	€ 0	€ 154 634

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	€ 3	€ 0	€ 3
BOA	10	0	10	(9)	(440)	(449)
BPS	(6)	0	(6)	(397)	360	(37)
BRC	(28)	0	(28)	(93)	0	(93)
CBK	(17)	0	(17)	(65)	290	225
CLY	S/O	S/O	S/O	1	0	1
FAR	(36)	0	(36)	S/O	S/O	S/O
GLM	0	(165)	(165)	(80)	(169)	(249)
GST	S/O	S/O	S/O	(312)	253	(59)
JPM	(26)	9	(17)	(326)	262	(64)
MBC	(194)	0	(194)	(27)	0	(27)
MYC	(298)	(247)	(545)	(309)	(253)	(562)
MYI	11	0	11	(18)	0	(18)
RBC	5	0	5	S/O	S/O	S/O
RYL	S/O	S/O	S/O	6	0	6
SCX	18	0	18	6	0	6
SSB	S/O	S/O	S/O	391	(328)	63
SOG	307	(412)	(105)	S/O	S/O	S/O
UAG	(144)	0	(144)	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	87,93	78,37
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	10,30	13,20
Autres valeurs mobilières	0,02	S/O
Fonds d'investissement	8,03	8,90
Contrats de mise en pension	0,20	2,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,27)	0,34
Instruments financiers dérivés compensés	(1,37)	(0,02)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,27)	(0,58)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	30,04	39,32
Agences du gouvernement américain	9,05	5,19
Obligations du Trésor américain	8,22	2,49
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	18,89	14,49
Titres adossés à des actifs	21,73	15,94
Émissions souveraines	10,00	7,09
Titres privilégiés	0,32	0,30
Instruments à court terme	S/O	6,75
Fonds d'investissement	8,03	8,90
Contrats de mise en pension	0,20	2,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,25)	0,34
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,02)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,26)	(0,21)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,01	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(1,12)	0,18
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	S/O	0,48
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,23)	(1,25)
Contrats de change à terme	(0,04)	0,19
Autres actifs et passifs à court terme	(4,57)	(2,29)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INDONÉSIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Perusahaan Perseroan PT Perusahaan Listrik Negara 3,000 % éch. 30/06/2030	\$ 3 500	\$ 2 997	0,73
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement indonésien 8,375 % éch. 15/03/2034	IDR 22 982 000	1 765	0,43
Total Indonésie		4 762	1,16
IRLANDE			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS			
Accunia European CLO DAC 4,127 % éch. 15/07/2030	€ 426	459	0,11
Ares European CLO DAC 3,957 % éch. 15/10/2031	1 100	1 180	0,29
Armada Euro CLO DAC 3,897 % éch. 15/07/2031	400	427	0,10
Aurium CLO DAC 3,907 % éch. 16/01/2031	1 098	1 175	0,29
BNPP AM Euro CLO DAC 4,031 % éch. 22/07/2032	1 000	1 066	0,26
Cairn CLO DAC 3,842 % éch. 30/04/2031	394	422	0,10
Carlyle Euro CLO DAC 3,877 % éch. 15/01/2031	996	1 063	0,26
Dryden Euro CLO DAC 3,837 % éch. 15/04/2033	700	747	0,18
4,183 % éch. 15/05/2034	1 000	1 068	0,26
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 4,100 % éch. 20/01/2032	1 000	1 064	0,26
Harvest CLO DAC 3,880 % éch. 20/10/2031	800	855	0,21
3,937 % éch. 15/07/2031	1 100	1 171	0,28
4,027 % éch. 15/01/2032	1 100	1 174	0,29
4,250 % éch. 28/06/2030	975	1 042	0,25
Jubilee CLO DAC 3,777 % éch. 15/04/2030	600	639	0,16
3,827 % éch. 15/04/2031	400	426	0,10
Madison Park Euro Funding DAC 3,977 % éch. 15/07/2032	1 100	1 170	0,28
Man GLG Euro CLO DAC 3,987 % éch. 15/10/2032	1 099	1 168	0,28
4,216 % éch. 15/12/2031	599	642	0,16
Oak Hill European Credit Partners DAC 3,940 % éch. 20/10/2031	1 100	1 169	0,28
OCF Euro CLO DAC 4,091 % éch. 22/09/2034	800	850	0,21
Palmer Square European Loan Funding DAC 3,907 % éch. 15/07/2031	963	1 026	0,25
Sculptor European CLO DAC 3,916 % éch. 14/01/2032	1 100	1 179	0,29
		21 182	5,15
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AerCap Ireland Capital DAC 2,450 % éch. 29/10/2026	\$ 400	357	0,09
3,000 % éch. 29/10/2028	500	433	0,10
		790	0,19
Total Irlande		21 972	5,34
ISRAËL			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS 6 000	1 596	0,39
1,750 % éch. 31/08/2025	2 100	537	0,13
2,000 % éch. 31/03/2027	2 700	681	0,16
4,500 % éch. 17/01/2033	\$ 2 200	2 169	0,53
Total Israël		4 983	1,21
ITALIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % éch. 17/07/2023	€ 389	424	0,10
4,625 % éch. 06/02/2027	600	651	0,16

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INDONÉSIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % éch. 08/10/2027	€ 1 300	\$ 1 266	0,31
UniCredit SpA 7,830 % éch. 04/12/2023	\$ 1 100	1 107	0,27
		3 448	0,84
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % éch. 05/05/2026	600	593	0,14
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % éch. 15/09/2024 (e)	€ 23 519	25 825	6,28
Obligation internationale du gouvernement italien 6,000 % éch. 04/08/2028	£ 1 000	1 241	0,30
		27 659	6,72
Total Italie		31 107	7,56
CÔTE D'IVOIRE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,250 % éch. 22/03/2030	€ 1 600	1 480	0,36
5,875 % éch. 17/10/2031	700	641	0,15
Total Côte d'Ivoire		2 121	0,51
JAPON			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Nomura Holdings, Inc. 2,329 % éch. 22/01/2027	\$ 400	354	0,09
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 % éch. 07/11/2029	€ 1 300	1 157	0,28
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,520 % éch. 13/01/2028	\$ 1 200	1 206	0,29
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % éch. 15/10/2027	€ 1 000	927	0,22
		3 644	0,88
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/10/2024	¥ 1 050 000	7 277	1,77
0,100 % éch. 10/03/2028 (e)	893 665	6 517	1,58
0,100 % éch. 10/03/2029 (e)	527 015	3 860	0,94
0,500 % éch. 20/03/2049	238 000	1 395	0,34
0,700 % éch. 20/06/2051	254 000	1 530	0,37
		20 579	5,00
Total Japon		24 223	5,88
KAZAKHSTAN			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
KazMunayGas National Co. JSC 3,500 % éch. 14/04/2033	\$ 1 550	1 204	0,29
5,750 % éch. 19/04/2047	200	163	0,04
6,375 % éch. 24/10/2048	400	343	0,09
Total Kazakhstan		1 710	0,42
LUXEMBOURG			
ACTIONS			
ACTIONS ORDINAIRES			
DrillCo Holding Lux S.A. (b)	6 700	129	0,03
DrillCo Holding Lux S.A. (b)(i)	16 048	308	0,08
Total des Actions ordinaires		437	0,11
VALEUR NOMINALE (en milliers)			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Aroundtown S.A. 0,375 % éch. 15/04/2027	€ 700	550	0,13
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,900 % éch. 12/10/2029	300	240	0,06
CPI Property Group S.A. 1,625 % éch. 23/04/2027	700	558	0,13

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
1,750 % éch. 14/01/2030	€ 300	\$ 199	0,05
FORESEA Holding S.A. 7,500 % éch. 15/06/2030	\$ 284	250	0,06
Logicor Financing SARL 0,625 % éch. 17/11/2025	€ 200	191	0,05
0,750 % éch. 15/07/2024	600	624	0,15
TMS Issuer SARL 5,780 % éch. 23/08/2032	\$ 800	825	0,20
		3 437	0,83
TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Miravet SARL 4,265 % éch. 26/05/2065	€ 485	521	0,13
Total Luxembourg		4 395	1,07
MALAISIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Petronas Capital Ltd. 2,480 % éch. 28/01/2032	\$ 500	418	0,10
3,500 % éch. 21/04/2030	200	185	0,05
4,550 % éch. 21/04/2050	200	184	0,04
4,800 % éch. 21/04/2060	200	188	0,05
Total Malaisie		975	0,24
MULTINATIONALES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Preferred Term Securities Ltd. 5,914 % éch. 23/06/2035	1 056	992	0,24
PAYS-BAS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Cooperatieve Rabobank UA 3,758 % éch. 06/04/2033	400	348	0,08
CTP NV 0,500 % éch. 21/06/2025	€ 1 100	1 070	0,26
ING Groep NV 2,125 % éch. 23/05/2026	500	520	0,13
Prosus NV 1,207 % éch. 19/01/2026	1 500	1 491	0,36
3,257 % éch. 19/01/2027	\$ 1 600	1 447	0,35
		4 876	1,18
TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Jubilee Place BV 4,177 % éch. 17/10/2057	€ 443	484	0,12
Total Pays-Bas		5 360	1,30
NOUVELLE-ZÉLANDE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais 1,500 % éch. 15/05/2031	NZD 600	294	0,07
NORVÈGE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Kommunalbanken A/S 1,900 % éch. 19/01/2027	AUD 400	242	0,06
Obligation internationale du gouvernement norvégien 1,750 % éch. 13/03/2025	NOK 6 000	539	0,13
Total Norvège		781	0,19
PÉROU			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % éch. 17/09/2024	PEN 1 700	449	0,11
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,200 % éch. 12/08/2026	2 100	616	0,15
Total Pérou		1 065	0,26

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
PHILIPPINES			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement philippin 6,250 % éch. 14/01/2036	PHP	21 000	\$ 379 0,09
POLOGNE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement polonais			
3,875 % éch. 14/02/2033	€	1 300	1 409 0,34
4,250 % éch. 14/02/2043		900	966 0,23
4,875 % éch. 04/10/2033	\$	400	393 0,10
5,500 % éch. 16/11/2027		100	103 0,03
5,500 % éch. 04/04/2053		300	303 0,07
Total Pologne		3 174	0,77
PORTUGAL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Espírito Santo S.A. 4,000 % éch. 21/01/2019 ^ 4,750 % éch. 15/01/2018 ^	€	1 900	508 0,12 160 0,04
Total Portugal		668	0,16
QATAR			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
QatarEnergy 2,250 % éch. 12/07/2031 3,300 % éch. 12/07/2051	\$	200	168 0,04 147 0,04
Total Qatar		315	0,08
ROUMANIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement roumain			
1,375 % éch. 02/12/2029	€	360	305 0,08
1,750 % éch. 13/07/2030		1 300	1 085 0,26
2,000 % éch. 28/01/2032		100	80 0,02
2,000 % éch. 14/04/2033		800	618 0,15
2,124 % éch. 16/07/2031		300	249 0,06
2,625 % éch. 02/12/2040		100	67 0,02
2,750 % éch. 14/04/2041		200	134 0,03
2,875 % éch. 13/04/2042		500	336 0,08
6,625 % éch. 27/09/2029		800	909 0,22
Total Roumanie		3 783	0,92
RUSSIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement russe			
1,125 % éch. 20/11/2027 ^	€	2 000	1 025 0,25
4,750 % éch. 27/05/2026 ^	\$	200	101 0,03
7,700 % éch. 23/03/2033 ^	RUB	33 500	135 0,03
Total Russie		1 261	0,31
ARABIE SAOUDITE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite			
3,250 % éch. 22/10/2030	\$	200	182 0,04
4,750 % éch. 18/01/2028		1 200	1 191 0,29
4,875 % éch. 18/07/2033		1 300	1 300 0,32
5,000 % éch. 18/01/2053		900	835 0,20
Total Arabie saoudite		3 508	0,85
SERBIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement serbe			
2,050 % éch. 23/09/2036	€	400	268 0,06
3,125 % éch. 15/05/2027		2 500	2 454 0,60
Total Serbie		2 722	0,66
SINGAPOUR			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
CapitaLand Ascendas REIT 0,750 % éch. 23/06/2028		1 000	873 0,21
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,650 % éch. 19/05/2030	\$	400	396 0,10
Total Singapour		1 269	0,31

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SLOVÉNIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % éch. 27/01/2025	€	400	\$ 422 0,10
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % éch. 05/02/2030		400	371 0,09
Total Slovénie		793	0,19
AFRIQUE DU SUD			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement sud-africain			
5,375 % éch. 24/07/2044	\$	300	214 0,05
5,750 % éch. 30/09/2049		200	142 0,04
Total Afrique du Sud		356	0,09
CORÉE DU SUD			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen			
2,000 % éch. 10/06/2031	KRW	1 018 830	686 0,16
2,125 % éch. 10/06/2027		680 000	487 0,12
2,375 % éch. 10/12/2028		2 960 000	2 103 0,51
3,250 % éch. 10/06/2033		1 728 590	1 268 0,31
4,250 % éch. 10/12/2032		4 950 810	3 926 0,95
5,500 % éch. 10/03/2028		640 000	524 0,13
Total Corée du Sud		8 994	2,18
ESPAGNE			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS			
BBVA Consumer Auto 0,270 % éch. 20/07/2031	€	145	154 0,04
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Santander S.A. 1,849 % éch. 25/03/2026 3,496 % éch. 24/03/2025	\$	200	179 0,04 767 0,19
CaixaBank S.A. 1,750 % éch. 24/10/2023	€	600	650 0,16
Total Espagne		1 596	0,39
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Communauté autonome de Catalogne 4,220 % éch. 26/04/2035		300	325 0,08
Obligation internationale du gouvernement espagnol			
1,450 % éch. 31/10/2071		500	264 0,06
3,450 % éch. 30/07/2066		2 000	1 990 0,48
Total Espagne		2 579	0,62
SUPRANATIONALES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banque de développement asiatique 6,150 % éch. 25/02/2030	INR	252 300	2 972 0,72
SUISSE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Credit Suisse AG 6,500 % éch. 08/08/2023 (h)	\$	1 400	1 395 0,34
UBS Group AG			
4,125 % éch. 24/09/2025		200	191 0,05
6,373 % éch. 15/07/2026		500	497 0,12
6,537 % éch. 12/08/2033		300	307 0,07
7,000 % éch. 30/09/2027	£	300	376 0,09
7,375 % éch. 07/09/2033		200	267 0,06
7,750 % éch. 01/03/2029	€	1 900	2 299 0,56
9,016 % éch. 15/11/2033	\$	500	600 0,15
Total Suisse		5 932	1,44
ÉMIRATS ARABES UNIS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
MDGM GMTN RSC Ltd. 5,500 % éch. 28/04/2033		200	211 0,05

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Antofagasta PLC 2,375 % éch. 14/10/2030	\$	400	\$ 326 0,08
Barclays PLC 6,224 % éch. 09/05/2034 7,437 % éch. 02/11/2033		600	598 0,14 325 0,08
Haleon UK Capital PLC 3,125 % éch. 24/03/2025		700	669 0,16
HSBC Holdings PLC 2,251 % éch. 22/11/2027 4,041 % éch. 13/03/2028 4,583 % éch. 19/06/2029		400	355 0,09 200 188 0,05 1 000 942 0,23
Nationwide Building Society 2,972 % éch. 16/02/2028		1 300	1 169 0,28
NatWest Group PLC 5,076 % éch. 27/01/2030		1 100	1 050 0,25
Santander UK Group Holdings PLC 2,469 % éch. 11/01/2028 6,534 % éch. 10/01/2029		500	437 0,11 1 300 1 310 0,32
Standard Chartered PLC 0,991 % éch. 12/01/2025 2,608 % éch. 12/01/2028 2,678 % éch. 29/06/2032 4,000 % éch. 30/01/2026		800	776 0,19 600 532 0,13 400 314 0,08 400 377 0,09
TP ICAP Finance PLC 2,625 % éch. 18/11/2028	£	400	376 0,09
Total Royaume-Uni		9 744	2,37
TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Alba PLC 5,191 % éch. 17/03/2039		854	1 044 0,25
Avon Finance PLC 5,809 % éch. 20/09/2048		539	685 0,17
Canada Square Funding PLC 5,682 % éch. 17/06/2058		623	787 0,19
Eurosaif PLC 3,629 % éch. 13/03/2045 5,140 % éch. 13/03/2045	€ £	10 195	10 0,00 246 0,06
Great Hall Mortgages PLC 5,152 % éch. 18/03/2039 5,166 % éch. 18/06/2039 5,644 % éch. 18/06/2039		18 169 115	23 0,01 212 0,05 114 0,03
Paragon Mortgages PLC 5,752 % éch. 15/05/2045	£	135	171 0,04
Polaris PLC 5,631 % éch. 23/12/2058		668	845 0,21
Resloc UK PLC 5,161 % éch. 15/12/2043		474	581 0,14
Ripon Mortgages PLC 5,491 % éch. 28/08/2056		2 983	3 779 0,92
RMAC Securities PLC 5,154 % éch. 12/06/2044		549	668 0,16
Stratton Mortgage Funding PLC 5,391 % éch. 20/07/2060 5,765 % éch. 12/03/2052 5,792 % éch. 25/09/2051		1 237 566 889	1 572 0,38 717 0,17 1 128 0,27
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,841 % éch. 20/07/2045		940	1 196 0,29
Trinity Square PLC 5,316 % éch. 15/07/2059		573	728 0,18
Total Royaume-Uni		14 506	3,52
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2024 (e) 0,125 % éch. 22/03/2051 (e) 0,125 % éch. 22/03/2068 (e) 0,625 % éch. 22/11/2042 (e) 0,625 % éch. 22/10/2050 1,250 % éch. 31/07/2051 1,500 % éch. 31/07/2053		5 533 291 164 175 1 300 370 300	6 900 1,68 295 0,07 166 0,04 212 0,05 672 0,16 233 0,06 199 0,05
Total Royaume-Uni		8 677	2,11
Total Royaume-Uni		32 927	8,00

DESCRIPTION	VALEUR		EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR		EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR		EN % DE L'ACTIF NET	
	NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)			NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)			NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)		
4,000 % éch. 01/08/2053	\$ 17 800	\$ 16 720	4,06	2,875 % éch. 30/04/2025	\$ 9 300	\$ 8 957	2,18	BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
4,500 % éch. 01/08/2053	23 300	22 414	5,45	3,500 % éch. 15/02/2033	1 300	1 266	0,31	16,220 % éch. 06/07/2023				
5,000 % éch. 01/08/2053	17 400	17 054	4,14	4,000 % éch. 29/02/2028	300	298	0,07	(c)(d)	HUF	831 000	\$ 2 426	0,58
5,500 % éch. 01/08/2053	23 300	23 185	5,63					Total des Instruments à court terme			3 280	0,80
6,000 % éch. 01/08/2053	32 100	32 378	7,87									
6,500 % éch. 01/07/2053	31 900	32 571	7,91	Total États-Unis		256 683	62,35				\$ 518 780	126,03
		157 879	38,35									
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				INSTRUMENTS À COURT TERME				ACTIONS				
BILLETS DE TRÉSORERIE				BILLETS DE TRÉSORERIE				FONDS D'INVESTISSEMENT				
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				BILLETS DE TRÉSORERIE				ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
Obligations du Trésor américain				Conagra Foods, Inc.				PIMCO Select Funds plc -				
1,625 % éch. 15/11/2050				5,750 % éch. 05/07/2023				Fonds PIMCO US Dollar				
1,875 % éch. 15/02/2041				Global Payments, Inc.				Short-Term Floating				
2,875 % éch. 15/05/2052				5,930 % éch. 28/07/2023				NAV Fund (g)				
4,000 % éch. 15/11/2052								1 573 660				
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)								15 670				
0,125 % éch. 15/04/2025								3,81				
0,125 % éch. 15/07/2030								PIMCO Specialty Funds				
0,125 % éch. 15/07/2031								Ireland p.l.c. - Fonds				
0,125 % éch. 15/01/2032								PIMCO China Bond				
0,250 % éch. 15/01/2025								Fund (g)				
0,250 % éch. 15/02/2050								446 527				
0,500 % éch. 15/01/2028								5 819				
0,625 % éch. 15/07/2032								1,41				
0,750 % éch. 15/07/2028								Total des Fonds d'investissement				
1,125 % éch. 15/01/2033								\$ 21 489				
Billets du Trésor américain								5,22				

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 2 347	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	\$ (2 394)	\$ 2 347	\$ 2 347	0,57	
Total des Contrats de mise en pension							\$ (2 394)	\$ 2 347	\$ 2 347	0,57

(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	96	\$ 255	0,06
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	41	14	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Long	06/2024	41	(9)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre	Court	09/2023	28	11	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Court	09/2023	50	20	0,00
Exercice d'une Option d'achat à 170,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur Euro-OAT septembre 2023 ⁽¹⁾	Long	08/2023	41	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre	Court	09/2023	1	2	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	202	368	0,09
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	118	(129)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	105	113	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	4	5	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	5	(11)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Court	09/2023	213	235	0,06
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	272	64	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	11	(41)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Court	09/2023	10	30	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	107	212	0,05
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	5	(6)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	67	90	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Court	09/2023	24	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	3	6	0,00
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	135	175	0,04
				\$ 1 405	0,34

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	9	\$ (4)	\$ (3)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	9	(3)	(1)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	98,000	15/12/2023	7	(6)	0	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	7	(6)	(33)	(0,01)
				\$ (19)	\$ (37)	(0,01)

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 1 368 0,33

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 %	20/12/2023	\$ 300	\$ (3)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2025	400	12	0,00
				\$ 9	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 à 10 ans	(1,000) %	20/06/2033	\$ 59 000	\$ (606)	(0,15)
Indice iTraxx Europe Main 39 à 10 ans	(1,000)	20/06/2033	€ 6 700	(94)	(0,02)
				\$ (700)	(0,17)

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 à 5 ans	1,000 %	20/06/2028	\$ 39 700	\$ 189	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 ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250 %	20/09/2053	£ 900	\$ (80)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	31 900	(1 727)	(0,42)
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	3 200	(204)	(0,05)
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	900	(33)	(0,01)
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	16/03/2032	INR 63 900	(56)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	15/03/2028	678 215	(27)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2028	¥ 250 000	(19)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	17/03/2031	230 000	(36)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	440 000	(21)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	19/06/2039	280 000	174	0,04
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,789	23/01/2033	1 356 000	(230)	(0,06)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	300 000	118	0,03
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,000	15/03/2028	SGD 2 370	(45)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	25/08/2023	\$ 8 100	(112)	(0,03)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	31/08/2023	9 500	(132)	(0,03)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	15/09/2023	10 200	(142)	(0,03)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	18/09/2023	200	(3)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	10 400	878	0,21
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	10 080	(501)	(0,12)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,249	31/08/2024	9 500	664	0,16
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2026	10 200	1 192	0,30
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,298	25/08/2024	8 100	579	0,14
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,430	31/03/2024	200	6	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	18/12/2024	200	18	0,00
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/12/2028	9 900	(1 309)	(0,32)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,518	20/01/2029	800	(99)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630	20/01/2029	2 300	(272)	(0,07)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630	26/01/2029	500	(59)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	10 740	81	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	19 230	344	0,08
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	520	15	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	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,850 %	21/04/2024	\$ 21 900	\$ 498	0,12
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	15/12/2051	2 000	(699)	(0,17)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,209	31/03/2024	2 236	68	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,400	21/06/2024	600	(16)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	1 080	(34)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,906	16/09/2052	600	(40)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,965	30/11/2026	16 400	825	0,20
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,968	30/06/2024	13 100	(301)	(0,07)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	3 980	63	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	400	(17)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,070	15/11/2032	2 500	112	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,083	15/11/2032	2 300	100	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,086	15/11/2032	2 600	87	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	1 200	(48)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,106	15/11/2032	1 900	79	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,139	15/11/2032	2 400	94	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,150	13/05/2025	42 700	416	0,10
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,163	30/09/2029	3 100	(117)	(0,03)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,165	03/10/2053	600	2	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,173	15/11/2032	1 700	63	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,174	15/11/2032	1 800	65	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,200	13/05/2025	2 700	31	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,225	30/09/2029	2 100	(73)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,240	03/10/2053	600	10	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	7 400	81	0,02
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	20/12/2053	2 400	10	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,445	03/10/2038	1 800	1	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,454	30/06/2029	2 900	(51)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	700	(12)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/06/2030	1 000	(9)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2030	100	1	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2033	301	(2)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	400	(6)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,533	03/10/2038	1 800	(18)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	21/06/2025	9 600	154	0,04
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	20/12/2028	5 584	49	0,01
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,752	03/10/2028	2 300	(4)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	700	(6)	0,00
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,850	03/10/2028	2 300	6	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,898	30/06/2029	3 200	18	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,159	31/03/2025	14 500	232	0,06
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,250	20/12/2025	31 996	169	0,04
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,409	04/10/2024	4 500	(57)	(0,01)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,409	04/10/2024	4 500	59	0,01
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,427	27/09/2024	10 300	(122)	(0,03)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,427	27/09/2024	10 300	105	0,03
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,433	06/09/2024	21 300	(257)	(0,07)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,433	06/09/2024	21 300	222	0,06
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,789	07/03/2024	3 400	(27)	(0,01)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,789	07/03/2024	3 400	15	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,280	04/01/2027	BRL 1 600	27	0,01
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,220	03/03/2025	CAD 6 700	(402)	(0,10)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2025	2 600	(159)	(0,04)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	1 600	(131)	(0,03)
À recevoir	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,750	16/12/2046	1 400	162	0,04
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,900	18/12/2029	3 700	(336)	(0,08)
À recevoir	Bon bancaire en CAD à 3 mois	3,250	15/03/2033	1 900	69	0,02
À payer	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,250	21/06/2033	7 000	49	0,01
À recevoir	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,250	21/06/2053	3 000	(61)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,500	10/05/2025	58 900	(361)	(0,09)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,283	14/02/2027	CHF 1 700	(115)	(0,03)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,294	10/02/2027	4 400	(285)	(0,07)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,300	15/02/2027	1 700	(113)	(0,03)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,343	16/05/2027	1 300	(86)	(0,02)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,500	15/09/2026	900	(79)	(0,02)
À recevoir	CNREPOFIX CNY 3 mois	2,250	21/12/2027	CNY 12 600	(31)	(0,01)
À recevoir	CNREPOFIX CNY 3 mois	2,500	21/12/2027	69 500	(165)	(0,04)
À recevoir	CNREPOFIX CNY 3 mois	2,750	21/06/2028	25 500	(60)	(0,01)
À payer	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,000	23/11/2024	€ 9 400	(174)	(0,04)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2028	KRW 22 984 540	(309)	(0,08)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2033	472 359	1	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	20/09/2033	2 534 930	5	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	0,528	17/03/2024	NZD 350	(7)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,250	21/03/2028	2 600	(294)	(0,07)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,750	15/06/2027	4 100	(38)	(0,01)
À payer	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024	24 900	(225)	(0,05)
À payer ⁽⁴⁾	BBR NZD à 3 mois	4,750	20/03/2025	12 400	(43)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	BBR NZD à 3 mois	5,250	20/03/2025	11 700	(8)	0,00
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	0,500	19/06/2024	SEK 12 700	(58)	(0,01)
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	1,000	19/06/2029	16 100	(223)	(0,05)
À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	15/03/2028	THB 138 460	47	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 recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000 %	25/08/2023	\$ 8 100	\$ 112	0,03
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	31/08/2023	9 500	133	0,03
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	15/09/2023	10 200	145	0,03
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	18/09/2023	200	3	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/09/2023	9 900	(103)	(0,03)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/07/2023	800	(5)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	20/07/2023	2 300	(12)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/07/2023	500	(3)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/09/2023	2 000	(18)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,409	04/07/2023	4 500	10	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,409	04/07/2023	4 500	(10)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,427	27/07/2023	10 300	(7)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,427	27/09/2023	10 300	32	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,433	06/07/2023	21 300	(9)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,433	06/09/2023	21 300	63	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,789	07/07/2023	3 400	(2)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,789	07/09/2023	3 400	7	0,00
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,250	17/06/2030	AUD 5 700	563	0,14
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/03/2027	1 900	(114)	(0,03)
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/06/2031	1 750	205	0,05
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,000	21/06/2033	4 200	(115)	(0,03)
À payer ⁽⁴⁾	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/09/2032	1 100	(5)	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/03/2033	12 400	(247)	(0,06)
À payer ⁽⁴⁾	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,500	15/09/2032	22 500	39	0,01
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	0,054	27/05/2050	€ 200	51	0,01
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,064	17/11/2052	500	178	0,04
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,450	15/12/2035	300	86	0,02
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	500	(22)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	1 400	(149)	(0,04)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	900	(94)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	700	(73)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	1 600	(150)	(0,04)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	700	(66)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	11/04/2024	3 900	(61)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	13/04/2024	8 800	(138)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	17/05/2024	1 800	(30)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	26/04/2024	1 300	(18)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	1 300	(19)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	1 200	(18)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037	1 400	(28)	(0,01)
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	12 800	(107)	(0,03)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	19/03/2027	17 660	(119)	(0,03)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	36 200	(214)	(0,05)
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	15/03/2033	7 860	(21)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	69 300	285	0,07
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	15 700	(5)	0,00
À recevoir	NIBOR NOK à 6 mois	1,635	18/03/2025	NOK 6 200	43	0,01
À recevoir	NIBOR NOK à 6 mois	1,993	12/11/2024	4 200	26	0,01
À payer	TIE MXN à 28 jours	4,870	07/07/2025	MXN 41 500	(119)	(0,03)
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,080	26/02/2025	10 500	(38)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,380	25/02/2025	12 300	(48)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,415	25/02/2025	300	(1)	0,00
					\$ (2 929)	(0,71)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (3 431)	(0,83)

(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.

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 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,180 %	11/01/2024	1 900	\$ 54	\$ 195	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 hors cote, 0,750 % échéance 25/05/2052	€ 97,000	23/05/2025	800	\$ 61	\$ 334	0,08

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 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	1 300	\$ (4)	\$ 0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	1 300	(4)	(18)	(0,01)
	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)	(409)	(0,10)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	300	(2)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	300	(2)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,060	14/07/2023	200	(1)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,360	14/07/2023	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	3,200	06/07/2023	210	(1)	0	0,00
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	210	(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	(60)	(306)	(0,08)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	100	(1)	0	0,00
DUB	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	700	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	700	(4)	(15)	(0,01)
	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)	(2)	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)	(30)	(0,01)
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,100	31/08/2023	900	(7)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	31/08/2023	900	(7)	(9)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	500	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	500	(3)	(11)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	500	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	500	(3)	(10)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	600	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	600	(4)	(12)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	600	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	600	(4)	(11)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	500	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	500	(3)	(9)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,97	25/10/2023	600	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	600	(4)	(12)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	400	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	400	(3)	(9)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	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	3,088	03/11/2023	300	(2)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	900	(6)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	900	(6)	(19)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	1 600	(6)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	1 600	(6)	(21)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	1 000	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	1 000	(3)	(14)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	900	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	900	(3)	(11)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,69	02/04/2024	2 000	(16)	(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	2 000	(16)	(37)	(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)	(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	600	(5)	(11)	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	(32)	(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	10/07/2023	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	3,750	10/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,250	20/07/2023	700	(2)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	700	(2)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	400	(3)	0	0,00
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	400	(3)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	190	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	190	(1)	0	0,00
							\$ (357)	\$ (1 006)	(0,24)

⁽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 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)	15	5	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	500	(12)	18	6	0,00
					\$ (34)	\$ 51	\$ 17	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.

Tableau des investissements Fonds Global Advantage 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.

SWAPS SUR DEVISES 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 au LIBOR USD à 3 mois sur la base du montant notional de la devise livrée	04/01/2031	AUD 700	\$ 527	\$ 3	\$ (2)	\$ 1	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)	10	9	0,00
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)	9	(2)	0,00
						\$ (9)	\$ 17	\$ 8	0,00

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 %	15/03/2028	MYR 20 216	\$ (8)	\$ 37	\$ 29	0,01
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2033	12 340	(3)	31	28	0,01
BPS	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	5 219	(2)	10	8	0,00
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,545	05/05/2028	3 753	0	4	4	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,635	05/04/2024	7 015	(2)	1	(1)	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2033	1 606	3	1	4	0,00
JPM	À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,960	11/02/2029	COP 15 800	0	0	0	0,00
SCX	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	MYR 3 400	(10)	8	(2)	0,00
						\$ (22)	\$ 92	\$ 70	0,02

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	07/2023	MXN 26 761	\$ 1 454	\$ 0	\$ (103)	\$ (103)	(0,02)
	07/2023	NZD 208	126	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	PLN 515	124	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$ 1 705	£ 1 348	9	0	9	0,00
	08/2023	AUD 270	\$ 178	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	CNH 3 527	505	18	0	18	0,00
	08/2023	\$ 5 586	AUD 8 264	0	(79)	(79)	(0,02)
	08/2023	603	CAD 796	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	165	CNH 1 157	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	5 104	CNY 35 027	0	(258)	(258)	(0,06)
	08/2023	454	¥ 64 900	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	TWD 16 946	\$ 558	13	0	13	0,00
	09/2023	\$ 446	CLP 364 511	4	0	4	0,00
	09/2023	1 461	HKD 11 414	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	926	INR 76 598	5	0	5	0,00
	09/2023	476	KRW 603 042	0	(16)	(16)	0,00
	09/2023	440	PEN 1 614	3	0	3	0,00
BPS	07/2023	463	CZK 9 957	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	504	£ 393	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	481	MYR 2 210	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	53	SGD 71	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	CNH 26 112	\$ 3 703	101	0	101	0,02
	08/2023	€ 1 979	2 170	7	0	7	0,00
	08/2023	TWD 8 482	278	5	0	5	0,00
	08/2023	\$ 5 356	CNH 36 999	0	(253)	(253)	(0,06)
	08/2023	6 024	CNY 41 189	0	(326)	(326)	(0,08)
	08/2023	3 555	€ 3 250	1	(3)	(2)	0,00
	08/2023	313	ZAR 5 812	0	(6)	(6)	0,00
	09/2023	8	\$ 0	0	0	0	0,00
	09/2023	\$ 570	IDR 8 572 440	0	(1)	(1)	0,00
	12/2023	330	MXN 5 886	3	0	3	0,00
BRC	07/2023	422	£ 333	2	0	2	0,00
	07/2023	63	MYR 289	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	257	CNH 1 825	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	848	COP 3 613 553	7	0	7	0,00
	08/2023	858	¥ 113 582	0	(67)	(67)	(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				
	08/2023	\$	339	ZAR	6 266	\$	0	(9)	\$	(9)	0,00
	09/2023	IDR	39 603	\$	3		0	0		0	0,00
	09/2023	ILS	24		7		0	0		0	0,00
	09/2023	\$	25	IDR	373 724		0	0		0	0,00
	09/2023		64	PEN	233		0	0		0	0,00
BSH	07/2023		554		2 040		8	0		8	0,00
CBK	07/2023	BRL	1 268	\$	258		0	(5)		(5)	0,00
	07/2023	CLP	208 540		258		0	(2)		(2)	0,00
	07/2023	IDR	372 985		25		0	0		0	0,00
	07/2023	NZD	650		399		0	0		0	0,00
	07/2023	PEN	33 120		8 524		0	(613)		(613)	(0,15)
	07/2023	\$	408	CZK	8 787		0	(5)		(5)	0,00
	07/2023		10 083	PEN	36 727		48	0		48	0,01
	07/2023		959	PHP	52 328		0	(13)		(13)	0,00
	07/2023		873	RON	3 946		0	(5)		(5)	0,00
	08/2023	CLP	304 881	\$	368		0	(11)		(11)	0,00
	08/2023	CNH	5 595		803		31	0		31	0,01
	08/2023	DKK	61 305		8 855		0	(150)		(150)	(0,04)
	08/2023	€	972		1 046		0	(17)		(17)	0,00
	08/2023	TWD	8 831		289		6	0		6	0,00
	08/2023	\$	363	BRL	1 875		24	0		24	0,01
	08/2023		3 425	CAD	4 594		49	0		49	0,01
	08/2023		14	CNH	97		0	(1)		(1)	0,00
	08/2023		2 098	€	1 908		4	(16)		(12)	0,00
	08/2023		2 096	NOK	21 868		0	(52)		(52)	(0,01)
	08/2023		723	PEN	2 824		53	0		53	0,01
	08/2023		2 916	SEK	29 569		0	(173)		(173)	(0,04)
	09/2023	CNH	9 742	\$	1 367		20	0		20	0,00
	09/2023	KRW	5 414		4		0	0		0	0,00
	09/2023	\$	1 419	THB	49 085		1	(25)		(24)	(0,01)
	09/2023		1 090	VND	25 691 912		1	0		1	0,00
	10/2023	CLP	1 390	\$	2		0	0		0	0,00
	11/2023	ILS	5 907		1 765		163	0		163	0,04
CLY	08/2023	\$	245	CNH	1 739		0	(5)		(5)	0,00
	08/2023		2 367	NOK	24 805		0	(48)		(48)	(0,01)
DUB	07/2023	PEN	59 407	\$	16 296		0	(89)		(89)	(0,02)
	07/2023	\$	5 323	BRL	28 844		655	0		655	0,16
	07/2023		8 121	PEN	29 704		73	0		73	0,02
	08/2023	TWD	11 514	\$	377		7	0		7	0,00
	09/2023	\$	289	PEN	1 057		2	0		2	0,00
GLM	07/2023	BRL	29 117	\$	6 030		0	(6)		(6)	0,00
	07/2023	IDR	373 975		25		0	0		0	0,00
	07/2023	PEN	3 705		1 015		0	(7)		(7)	0,00
	07/2023	\$	287	BRL	1 449		13	0		13	0,00
	08/2023		1 696	CHF	1 501		0	(11)		(11)	0,00
	08/2023		922	NOK	9 780		0	(7)		(7)	0,00
	08/2023		457	PEN	1 667		1	0		1	0,00
	09/2023		6 030	BRL	29 440		5	0		5	0,00
	09/2023		558	PEN	2 052		5	0		5	0,00
	09/2023		1 997	SGD	2 670		0	(18)		(18)	0,00
	09/2023		1	THB	34		0	0		0	0,00
JPM	07/2023	KRW	5 164 251	\$	4 042		120	0		120	0,03
	07/2023	SGD	277		210		5	0		5	0,00
	07/2023	\$	63	PHP	3 424		0	(1)		(1)	0,00
	07/2023		1 678	SGD	2 218		0	(39)		(39)	(0,01)
	08/2023	CNH	2 069	\$	290		5	0		5	0,00
	08/2023	HUF	130 000		377		2	0		2	0,00
	08/2023	\$	3 052	CAD	4 080		33	0		33	0,01
	08/2023		2 556	CHF	2 248		0	(33)		(33)	(0,01)
	08/2023		4 096	CNH	28 306		0	(192)		(192)	(0,05)
	08/2023		6 354	CNY	43 453		0	(342)		(342)	(0,08)
	08/2023		141	¥	18 666		0	(11)		(11)	0,00
	08/2023		340	NOK	3 606		0	(3)		(3)	0,00
	09/2023	IDR	40 699	\$	3		0	0		0	0,00
	09/2023	ILS	23		6		0	0		0	0,00
	09/2023	\$	1	IDR	9 960		0	0		0	0,00
	09/2023		6 812	INR	561 424		12	0		12	0,00
	09/2023		4 395	PEN	16 181		43	0		43	0,01
	09/2023		1 357	THB	46 527		0	(35)		(35)	(0,01)
	12/2023		2 118	INR	174 780		0	(1)		(1)	0,00
	10/2024	¥	110 000	\$	890		74	0		74	0,02
MBC	07/2023	£	10 482		13 024		9	(311)		(302)	(0,07)
	08/2023	CAD	498		375		1	(2)		(1)	0,00
	08/2023	CNH	7 796		1 100		25	0		25	0,01
	08/2023	€	20 657		22 784		204	(2)		202	0,05
	08/2023	\$	248	CNH	1 783		0	(2)		(2)	0,00
	08/2023		549	HUF	187 162		0	(8)		(8)	0,00
	09/2023	IDR	943	\$	0		0	0		0	0,00
	09/2023	\$	176	IDR	2 614 097		0	(2)		(2)	0,00
	09/2023		803	KRW	1 023 838		0	(23)		(23)	(0,01)
	10/2024	¥	340 000	\$	2 725		203	0		203	0,05

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		
MYI	07/2023	£	290	\$	360	\$ 0	\$ (8)	0,00	
	07/2023	IDR	498 726		33	0	0	0,00	
	07/2023	\$	2	€	2	0	0	0,00	
	07/2023		8	IDR	122 933	0	0	0,00	
	07/2023		366	KZT	171 575	12	0	0,00	
	07/2023		20	MYR	92	0	0	0,00	
	08/2023	¥	41 300	\$	298	10	0	0,00	
	08/2023	TWD	16 924		557	13	0	0,00	
	08/2023	\$	670	€	613	1	0	0,00	
	08/2023		12 239	¥	1 626 444	0	(914)	(0,22)	
	08/2023		69	ZAR	1 340	2	0	0,00	
	09/2023	IDR	123 040	\$	8	0	0	0,00	
	09/2023	\$	816	IDR	12 183 983	0	(6)	(0,00)	
	09/2023		1 470	INR	121 264	4	0	0,00	
	09/2023		899	KRW	1 150 628	0	(22)	(0,01)	
	09/2023		619	THB	21 208	0	(17)	0,00	
	10/2024	¥	600 000	\$	4 906	456	0	0,11	
	RBC	07/2023	\$	5 604	MXN	107 822	671	0	0,16
		08/2023	CHF	59	\$	67	0	0	0,00
	SCX	08/2023	MXN	5 115		295	0	(1)	0,00
07/2023		NZD	541		329	0	(3)	0,00	
07/2023		\$	482	MYR	2 217	0	(6)	0,00	
08/2023		TWD	6 147		201	4	0	0,00	
08/2023		\$	425	AUD	634	0	(2)	0,00	
08/2023			2 269	CNH	15 609	0	(117)	(0,03)	
08/2023			16 900	CNY	115 378	0	(937)	(0,23)	
08/2023			259	€	237	0	0	0,00	
08/2023			417	¥	57 800	0	(15)	0,00	
09/2023		CNH	2 191	\$	307	4	0	0,00	
09/2023		TWD	14 174		465	9	0	0,00	
09/2023		\$	2 241	IDR	33 519 603	0	(15)	0,00	
09/2023			4 263	INR	351 124	5	0	0,00	
09/2023			818	KRW	1 042 034	0	(24)	(0,01)	
09/2023			248	PEN	919	4	0	0,00	
09/2023			1 894	THB	65 396	0	(36)	(0,01)	
SOG		07/2023		2 302	PLN	9 918	137	0	0,03
		07/2023		260	CLP	208 839	0	0	0,00
SSB		07/2023		8 144	PEN	29 705	47	0	0,01
		08/2023	CLP	209 442	\$	260	0	0	0,00
	08/2023	PEN	29 705		8 133	0	(42)	(0,01)	
	09/2023	BRL	1 918		378	0	(15)	0,00	
TOR	09/2023	KRW	2 672 560		2 061	24	0	0,01	
	07/2023	\$	11 053	£	8 698	6	0	0,00	
	07/2023		852	NZD	1 399	5	0	0,00	
	08/2023	CAD	404	\$	300	0	(6)	0,00	
	08/2023	£	8 698		11 055	0	(5)	0,00	
	08/2023	NZD	1 399		852	0	(5)	0,00	
UAG	08/2023	\$	5 649	¥	749 077	0	(433)	(0,11)	
	08/2023	CAD	76	\$	56	0	(1)	0,00	
	08/2023	\$	500	CNH	3 467	0	(22)	(0,01)	
	08/2023		215	€	196	0	(1)	0,00	
	08/2023		132	ZAR	2 531	2	0	0,00	
	09/2023	CNH	2 939	THB	14 234	0	(2)	0,00	
	09/2023	SGD	2 123	\$	1 588	15	0	0,00	
	09/2023	\$	877	INR	72 464	4	0	0,00	
09/2023		447	ZAR	7 833	0	(35)	(0,01)		
				\$ 3 518	\$ (6 139)	\$ (2 621)	(0,64)		

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	139	\$	91	\$ 0	\$ (2)	0,00
	07/2023	\$	275	AUD	414	1	0	0,00
BOA	08/2023	AUD	414	\$	275	0	(1)	0,00
	07/2023		780		509	0	(11)	0,00
	07/2023	CAD	3 534		2 597	0	(73)	(0,02)
	07/2023	DKK	913		132	0	(2)	0,00
	07/2023	¥	23 717		171	6	0	0,00
	07/2023	NOK	3 380		308	0	(8)	0,00
	07/2023	NZD	176		107	0	(1)	0,00
	07/2023	SEK	62		6	0	0	0,00
BPS	07/2023	\$	244	DKK	1 656	0	(1)	0,00
	08/2023	DKK	1 654	\$	244	1	0	0,00
	07/2023	CHF	34 850		38 967	13	0	0,00
	07/2023	DKK	3		0	0	0	0,00
	07/2023	¥	1 051 337		7 567	293	0	0,07
	07/2023	NZD	16		10	0	0	0,00
07/2023	\$	196	AUD	296	1	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	
	07/2023	\$	16 017	CHF 14 480	\$ 168	\$ 0	\$ 168	0,04
	07/2023		24 352	€ 22 225	0	(104)	(104)	(0,03)
	07/2023		74	NOK 791	0	0	0	0,00
	08/2023	AUD	296	\$ 196	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	€	22 225	24 386	105	0	105	0,02
	08/2023	NOK	790	74	0	0	0	0,00
	08/2023	\$	38 967	CHF 34 751	0	(13)	(13)	0,00
CBK	07/2023	NOK	147	\$ 13	0	(1)	(1)	0,00
CLY	07/2023	CHF	18 420	20 506	0	(83)	(83)	(0,02)
	07/2023	DKK	2 682	387	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	\$	20 506	CHF 18 367	83	0	83	0,02
GLM	07/2023		452	NOK 4 876	3	0	3	0,00
	08/2023	NOK	4 871	\$ 452	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07/2023	\$	2 560	¥ 366 105	0	(27)	(27)	(0,01)
	08/2023	¥	364 550	\$ 2 560	27	0	27	0,01
MBC	07/2023	CAD	2	1	0	0	0	0,00
	07/2023	£	3 552	4 397	0	(119)	(119)	(0,03)
	07/2023	SEK	115	11	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	1 022	CHF 928	16	0	16	0,00
MYI	07/2023	CHF	677	\$ 748	0	(9)	(9)	0,00
	07/2023	SEK	8 874	827	5	0	5	0,00
	07/2023	\$	217	DKK 1 477	0	0	0	0,00
	07/2023		840	SEK 9 065	0	0	0	0,00
	08/2023	DKK	1 475	\$ 217	0	0	0	0,00
	08/2023	SEK	9 054	840	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	AUD	821	537	0	(10)	(10)	0,00
	07/2023	NZD	460	279	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$	404	AUD 608	1	0	1	0,00
	07/2023		36 854	CHF 33 114	160	0	160	0,04
	08/2023	AUD	608	\$ 404	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07/2023		920	602	0	(10)	(10)	0,00
	07/2023	€	22 225	23 908	0	(339)	(339)	(0,08)
TOR	07/2023	AUD	487	319	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	\$	494	AUD 748	4	0	4	0,00
	07/2023		2 672	CAD 3 536	2	(2)	0	0,00
	07/2023		4 514	£ 3 552	2	0	2	0,00
	07/2023		4 923	¥ 708 899	0	(18)	(18)	0,00
	07/2023		397	NZD 652	2	0	2	0,00
	08/2023	AUD	748	\$ 495	0	(4)	(4)	0,00
	08/2023	CAD	3 535	2 672	2	(2)	0	0,00
	08/2023	£	3 552	4 515	0	(2)	0	0,00
	08/2023	¥	705 893	4 923	18	0	18	0,00
	08/2023	NZD	652	397	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07/2023	AUD	111	73	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	CHF	24 332	27 143	0	(54)	(54)	(0,01)
	07/2023	NOK	2 365	214	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	\$	797	AUD 1 193	2	(4)	(2)	0,00
	07/2023		33 657	CHF 30 242	146	0	146	0,03
	08/2023	AUD	1 193	\$ 797	5	(2)	3	0,00
	08/2023	\$	27 143	CHF 24 263	53	0	53	0,01
					\$ 1 119	\$ (931)	\$ 188	0,04

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	184	\$ 120	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07/2023	\$	531	AUD 800	2	0	2	0,00
	08/2023	AUD	800	\$ 531	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07/2023		1 400	913	0	(19)	(19)	(0,01)
	07/2023	CAD	6 667	4 900	0	(139)	(139)	(0,03)
	07/2023	DKK	1 698	245	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	€	26	28	0	0	0	0,00
	07/2023	NOK	6 187	563	0	(15)	(15)	0,00
	07/2023	NZD	221	134	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	SEK	115	11	0	(1)	0	0,00
	07/2023	\$	453	DKK 3 083	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023		10	¥ 1 395	0	0	0	0,00
	08/2023	DKK	3 078	\$ 453	2	0	2	0,00
BPS	07/2023	CHF	10	11	0	0	0	0,00
	07/2023	DKK	6	1	0	0	0	0,00
	07/2023	€	69 251	75 878	325	0	325	0,08
	07/2023	¥	1 938 587	13 953	541	0	541	0,13
	07/2023	NZD	20	12	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	379	AUD 572	2	0	2	0,00
	07/2023		2 120	CHF 1 896	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023		42 547	€ 39 569	623	0	623	0,15
	07/2023		135	NOK 1 447	0	0	0	0,00
	08/2023	AUD	572	\$ 379	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	CHF	1 891	2 120	1	0	1	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
	08/2023	NOK	1 446	\$ 135	\$ 0	\$ 0	0,00
	08/2023	\$	75 982	€ 69 249	0	(330)	(0,08)
CBK	07/2023	€	51	\$ 55	0	(1)	0,00
	07/2023	NOK	269	24	0	(1)	0,00
CLY	07/2023	DKK	4 991	720	0	(11)	0,00
	07/2023	\$	53	CHF 48	0	0	0,00
	08/2023	CHF	48	\$ 53	0	0	0,00
GLM	07/2023	\$	828	NOK 8 924	5	0	0,00
	08/2023	NOK	8 915	\$ 828	0	(5)	0,00
JPM	07/2023	AUD	1 123	734	0	(13)	0,00
	07/2023	€	38 737	42 297	35	0	0,01
	07/2023	\$	4 613	¥ 659 703	0	(49)	(0,01)
	08/2023	¥	656 900	\$ 4 613	49	0	0,01
	08/2023	\$	42 356	€ 38 737	0	(36)	(0,01)
MBC	07/2023	CAD	3	\$ 3	0	0	0,00
	07/2023	€	25	27	0	0	0,00
	07/2023	£	6 706	8 301	0	(225)	(0,06)
	07/2023	SEK	214	20	0	0	0,00
	07/2023	\$	474	£ 381	10	0	0,00
MYI	07/2023	CHF	14	\$ 16	0	0	0,00
	07/2023	SEK	16 512	1 538	10	0	0,00
	07/2023	\$	403	DKK 2 749	0	0	0,00
	07/2023	1 562	SEK 16 867	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	DKK	2 745	\$ 403	0	0	0,00
	08/2023	SEK	16 846	1 562	1	0	0,00
SCX	07/2023	AUD	1 585	1 036	0	(19)	(0,01)
	07/2023	CHF	1 847	2 056	0	(9)	0,00
	07/2023	NZD	576	349	0	(3)	0,00
	07/2023	\$	780	AUD 1 174	2	0	0,00
	08/2023	AUD	1 174	\$ 780	0	(2)	0,00
SOG	07/2023	1 213	794	0	(14)	(14)	0,00
	07/2023	\$	73 708	€ 68 519	1 047	0	0,25
TOR	07/2023	AUD	642	\$ 420	0	(7)	0,00
	07/2023	\$	955	AUD 1 445	7	0	0,00
	07/2023	5 041	CAD 6 671	4	(4)	0	0,00
	07/2023	8 037	£ 6 325	4	0	4	0,00
	07/2023	8 871	¥ 1 277 400	0	(33)	(33)	(0,01)
	07/2023	497	NZD 817	3	0	3	0,00
	08/2023	AUD	1 445	\$ 955	0	(7)	0,00
	08/2023	CAD	6 668	5 041	3	(3)	0,00
	08/2023	£	6 325	8 039	0	(4)	0,00
	08/2023	¥	1 271 983	8 871	33	0	0,01
	08/2023	NZD	817	497	0	(3)	0,00
UAG	07/2023	AUD	147	96	0	(2)	0,00
	07/2023	CHF	120	134	0	(1)	0,00
	07/2023	NOK	4 327	391	0	(13)	0,00
	07/2023	\$	1 538	AUD 2 303	3	(8)	(5)
	07/2023	52	CHF 47	0	0	0	0,00
	08/2023	AUD	2 303	\$ 1 539	8	(3)	0,00
	08/2023	CHF	47	52	0	0	0,00
				\$ 2 720	\$ (994)	\$ 1 726	0,42

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	46	\$ 30	\$ 0	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$	132	AUD 199	0	0	0,00
	08/2023	AUD	199	\$ 132	0	0	0,00
BOA	07/2023	348	227	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	CAD	1 667	1 225	0	(35)	(0,01)
	07/2023	DKK	451	65	0	(1)	0,00
	07/2023	£	85	106	0	(1)	0,00
	07/2023	¥	16 698	119	3	0	0,00
	07/2023	NZD	69	42	0	0	0,00
	07/2023	SEK	29	3	0	0	0,00
	07/2023	\$	120	DKK 818	0	0	0,00
	07/2023	111	¥ 15 429	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	16 898	NOK 186 026	466	0	466	0,11
	07/2023	388	SEK 4 190	0	0	0	0,00
	08/2023	DKK	817	\$ 120	0	0	0,00
	08/2023	SEK	4 185	388	0	0	0,00
BPS	07/2023	CHF	2	3	0	0	0,00
	07/2023	DKK	2	0	0	0	0,00
	07/2023	€	129	141	0	0	0,00
	07/2023	¥	496 394	3 573	138	0	0,03
	07/2023	NOK	56 578	5 263	0	(18)	0,00
	07/2023	NZD	6	4	0	0	0,00
	07/2023	\$	94	AUD 142	0	0	0,00
	07/2023	534	CHF 478	0	0	0	0,00
	07/2023	11 428	€ 10 430	0	(49)	(49)	(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	
	08/2023	AUD	142	\$ 94	\$ 0	\$ (1)	0,00	
	08/2023	CHF	476	534	0	0	0,00	
	08/2023	€	10 430	11 444	49	0	0,01	
CBK	08/2023	\$	5 263	NOK 56 523	19	0	0,00	
	07/2023	NOK	2 838	\$ 255	0	(9)	0,00	
	07/2023	\$	413	€ 385	7	0	0,00	
	07/2023		6 515	NOK 73 265	323	0	0,08	
CLY	07/2023	DKK	1 324	\$ 191	0	(3)	0,00	
	07/2023	\$	13	CHF 12	0	0	0,00	
	08/2023	CHF	12	\$ 13	0	0	0,00	
GLM	07/2023	NOK	166 319	15 431	0	(94)	(0,02)	
	08/2023	\$	15 431	NOK 166 156	94	0	0,02	
JPM	07/2023	AUD	279	\$ 182	0	(3)	0,00	
	07/2023	\$	1 185	¥ 169 477	0	(13)	0,00	
	08/2023	¥	168 757	\$ 1 185	13	0	0,00	
MBC	07/2023	CAD	1	1	0	0	0,00	
	07/2023	€	390	421	0	(4)	0,00	
	07/2023	£	1 648	2 040	0	(55)	(0,01)	
	07/2023	SEK	53	5	0	0	0,00	
	07/2023	\$	126	£ 101	3	0	0,00	
MYI	07/2023	CHF	4	\$ 4	0	0	0,00	
	07/2023	SEK	4 103	382	2	0	0,00	
	07/2023	\$	107	DKK 730	0	0	0,00	
SCX	08/2023	DKK	728	\$ 107	0	0	0,00	
	07/2023	AUD	394	257	0	(5)	0,00	
	07/2023	CHF	465	518	0	(2)	0,00	
	07/2023	NZD	179	108	0	(1)	0,00	
	07/2023	\$	194	AUD 292	1	0	0,00	
SOG	08/2023	AUD	292	\$ 194	0	(1)	0,00	
	07/2023		301	197	0	(3)	0,00	
	07/2023	€	10 297	11 077	0	(158)	(0,04)	
TOR	07/2023	AUD	159	104	0	(2)	0,00	
	07/2023	\$	237	AUD 359	2	0	0,00	
	07/2023		1 261	CAD 1 668	1	(1)	0,00	
	07/2023		2 073	£ 1 631	1	0	0,00	
	07/2023		2 279	¥ 328 163	0	(8)	0,00	
	07/2023		154	NZD 253	1	0	0,00	
	08/2023	AUD	359	\$ 237	0	(2)	0,00	
	08/2023	CAD	1 668	1 261	1	(1)	0,00	
	08/2023	£	1 631	2 074	0	(1)	0,00	
	08/2023	¥	326 772	2 279	8	0	0,00	
	08/2023	NZD	253	154	0	(1)	0,00	
UAG	07/2023	AUD	37	24	0	0	0,00	
	07/2023	CHF	30	34	0	0	0,00	
	07/2023	\$	382	AUD 572	1	(2)	0,00	
	07/2023		13	CHF 12	0	0	0,00	
	07/2023		16 091	NOK 178 058	530	0	0,13	
	08/2023	AUD	572	\$ 382	2	(1)	0,00	
	08/2023	CHF	12	13	0	0	0,00	
					\$ 1 665	\$ (485)	\$ 1 180	0,29

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 91 0,02

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 2,000 % éch. 01/07/2038 2,000 % éch. 01/08/2053	\$ 7 000 27 750	\$ (6 204) (22 669)	(1,51) (5,50)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (28 873)	(7,01)
Total des Investissements		\$ 511 771	124,33
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (100 156)	(24,33)
Actifs nets		\$ 411 615	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.

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

- (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 : 0,46 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Deutsche Bank AG 3,035 % échéance 28/05/2032	21/06/2021	\$ 1 062	\$ 828	0,20
DrillCo Holding Lux S.A.	08/06/2023	321	308	0,08
		\$ 1 383	\$ 1 136	0,28

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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 14 781 \$ (31 décembre 2022 : 13 884 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 2 840 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 517 946	\$ 834	\$ 518 780
Fonds d'investissement	21 489	0	0	21 489
Contrats de mise en pension	0	2 347	0	2 347
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	812	(2 784)	0	(1 972)
Titres vendus à découvert	0	(28 873)	0	(28 873)
Totaux	\$ 22 301	\$ 488 636	\$ 834	\$ 511 771

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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)	\$ 10	\$ 6	\$ 7	\$ 0	\$ 7
BOA	(437)	580	143	1 000	(730)	270
BOM	S/O	S/O	S/O	24	0	24
BPS	1 305	(1 250)	55	(629)	560	(69)
BRC	(69)	60	(9)	272	0	272
BSH	8	0	8	3	0	3
CBK	(355)	310	(45)	1 063	(1 120)	(57)
CLY	(73)	0	(73)	(8)	0	(8)
DUB	601	(460)	141	(125)	20	(105)
FAR	(10)	0	(10)	S/O	S/O	S/O
GLM	(216)	0	(216)	150	(370)	(220)
GST	S/O	S/O	S/O	4	0	4
HUS	S/O	S/O	S/O	(4)	0	(4)
IND	S/O	S/O	S/O	110	0	110
JPM	(389)	280	(109)	1 248	(760)	488
MBC	(282)	140	(142)	264	(90)	174
MYC	(8)	0	(8)	(5)	0	(5)
MYI	(461)	290	(171)	(909)	540	(369)
RBC	670	(660)	10	116	0	116

Contrepartie	Au 30 juin 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⁾
RYL	\$ S/O	\$ S/O	\$ S/O	\$ (2)	\$ 0	\$ (2)
SCX	(1 022)	830	(192)	992	(910)	82
SOG	660	(510)	150	77	(70)	7
SSB	14	0	14	S/O	S/O	S/O
TOR	(453)	340	(113)	6	0	6
UAG	612	(410)	202	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	89,34	65,89
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	36,58	41,33
Autres valeurs mobilières	0,11	0,88
Fonds d'investissement	5,22	4,44
Contrats de mise en pension	0,57	0,34
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,33	1,08
Instruments financiers dérivés compensés	(0,83)	(0,87)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,02	0,91
Titres vendus à découvert	(7,01)	(7,03)
Contrats de prise en pension	S/O	(0,37)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Argentine	0,02	0,02
Australie	1,65	1,74
Brésil	0,69	0,76
Bulgarie	0,55	S/O
Canada	0,67	0,73
Îles Caïmans	5,60	5,78
Chili	0,59	0,56
Chine	0,07	S/O
Colombie	0,48	0,02
République tchèque	0,11	0,10
Danemark	2,62	2,67
République dominicaine	0,17	0,16
France	2,99	2,83
Allemagne	2,13	2,33
Guatemala	0,09	0,10
Hong Kong	0,10	0,21
Hongrie	1,03	0,03
Indonésie	1,16	1,10
Irlande	5,34	5,34
Israël	1,21	0,98
Italie	7,56	7,32
Côte d'Ivoire	0,51	0,35
Japon	5,88	4,40
Kazakhstan	0,42	S/O
Luxembourg	1,07	0,67
Malaisie	0,24	0,98
Mexique	S/O	0,28
Maroc	S/O	0,37
Multinationales	0,24	0,25
Pays-Bas	1,30	1,59
Nouvelle-Zélande	0,07	0,07
Norvège	0,19	0,20
Pérou	0,26	1,68
Philippines	0,09	0,08
Pologne	0,77	0,03
Portugal	0,16	0,09
Qatar	0,08	0,08
Roumanie	0,92	0,63
Russie	0,31	0,20
Arabie saoudite	0,85	S/O
Serbie	0,66	0,88
Singapour	0,31	0,20
Slovénie	0,19	0,18
Afrique du Sud	0,09	0,09
Corée du Sud	2,18	0,78
Espagne	1,05	1,04
Supranationales	0,72	0,71
Suisse	1,44	1,64
Thaïlande	S/O	0,26
Émirats arabes unis	0,05	0,05
Royaume-Uni	8,00	9,05
États-Unis	62,35	45,54

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Instruments à court terme	0,80	2,95
Fonds d'investissement	5,22	4,44
Contrats de mise en pension	0,57	0,34
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,34	1,09
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	(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	(0,17)	(0,15)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,05	0,00
Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base	S/O	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(0,71)	(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		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,24)	(0,27)
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	0,01
Swaps sur devises croisées	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,02	0,00
Contrats de change à terme	(0,64)	0,37
Contrats de change à terme couverts	0,75	0,68
Titres vendus à découvert	(7,01)	(7,03)
Autres actifs et passifs à court terme	(24,33)	(06,97)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
5,125 % éch. 29/10/2022 ^	\$ 500	\$ 30	0,00
		56 689	0,45
TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Miravet SARL			
4,265 % éch. 26/05/2065	€ 13 365	14 356	0,11
Total Luxembourg		71 045	0,56

MALAISIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Petronas Capital Ltd.			
2,480 % éch. 28/01/2032	\$ 5 500	4 598	0,04
3,500 % éch. 21/04/2030	8 600	7 942	0,06
4,550 % éch. 21/04/2050	6 100	5 609	0,04
4,800 % éch. 21/04/2060	5 000	4 713	0,04
		22 862	0,18

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement malaisien			
2,632 % éch. 15/04/2031	MYR 36 118	7 123	0,06
Emission d'investissement du gouvernement malaisien			
3,465 % éch. 15/10/2030	21 759	4 561	0,03
		11 684	0,09
Total Malaisie		34 546	0,27

MEXIQUE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement mexicain			
4,000 % éch. 15/03/2115	€ 800	647	0,01
5,000 % éch. 27/04/2051 (i)	\$ 7 800	6 782	0,05
Total Mexique		7 429	0,06

MULTINATIONALES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Preferred Term Securities Ltd.			
5,862 % éch. 22/12/2036	8 973	8 344	0,07
5,952 % éch. 22/03/2038	2 939	2 587	0,02
Total Multinationales		10 931	0,09

PAYS-BAS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ABN AMRO Bank NV			
1,125 % éch. 12/01/2032	€ 300	277	0,00
Cooperatieve Rabobank UA			
3,758 % éch. 06/04/2033	\$ 2 300	2 000	0,02
CTP NV			
0,625 % éch. 27/09/2026	€ 10 500	9 263	0,07
0,875 % éch. 20/01/2026	14 100	13 136	0,11
1,500 % éch. 27/09/2031	6 500	4 949	0,04
ING Groep NV			
4,100 % éch. 02/10/2023	\$ 2 600	2 588	0,02
6,533 % éch. 02/10/2023	2 400	2 403	0,02
Sagax Euro MTN NL BV			
1,625 % éch. 24/02/2026	€ 11 900	11 630	0,09
		46 246	0,37

TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Domj BV			
4,376 % éch. 15/06/2051	120	131	0,00
Dutch Property Finance BV			
3,872 % éch. 28/04/2051	124	135	0,00
3,892 % éch. 28/07/2054	228	249	0,00
3,892 % éch. 28/07/2058	13 820	15 057	0,12
Eurosail BV			
4,677 % éch. 17/10/2040	39	42	0,00
Jubilee Place BV			
4,007 % éch. 17/07/2058	10 221	11 136	0,09
4,177 % éch. 17/10/2057	5 612	6 122	0,05
		32 872	0,26
Total Pays-Bas		79 118	0,63

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
NOUVELLE-ZÉLANDE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Auckland Council			
1,000 % éch. 19/01/2027	€ 5 800	5 792	0,04
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais			
1,500 % éch. 15/05/2031	NZD 22 600	11 062	0,09
2,000 % éch. 20/09/2025	1 279	783	0,01
Total Nouvelle-Zélande		17 637	0,14

NORVÈGE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Kommunalbanken A/S			
0,625 % éch. 20/04/2026	€ 600	603	0,00
1,900 % éch. 19/01/2027	AUD 22 000	13 306	0,11
5,250 % éch. 15/07/2024	3 300	2 205	0,02
Obligation internationale du gouvernement norvégien			
1,250 % éch. 17/09/2031	NOK 1 900	147	0,00
1,750 % éch. 13/03/2025	86 700	7 783	0,06
1,750 % éch. 17/02/2027	1 100	95	0,00
2,000 % éch. 26/04/2028	7 300	628	0,01
Total Norvège		24 767	0,20

PÉROU			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement péruvien			
2,780 % éch. 01/12/2060	\$ 6 000	3 684	0,03
3,230 % éch. 28/07/2121	4 200	2 553	0,02
5,940 % éch. 12/02/2029	PEN 5 817	1 577	0,01
6,150 % éch. 12/08/2032	40 948	10 829	0,09
Total Pérou		18 643	0,15

POLOGNE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement polonais			
3,875 % éch. 14/02/2033	€ 15 400	16 691	0,13
4,250 % éch. 14/02/2043	3 400	3 649	0,03
4,875 % éch. 04/10/2033	\$ 6 400	6 294	0,05
5,500 % éch. 16/11/2027	2 700	2 774	0,02
5,500 % éch. 04/04/2053	5 800	5 852	0,05
Total Pologne		35 260	0,28

PORTUGAL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Espírito Santo S.A.			
4,000 % éch. 21/01/2019 ^	€ 6 900	1 844	0,02
4,750 % éch. 15/01/2018 ^	1 900	508	0,00
Total Portugal		2 352	0,02

QATAR			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
QatarEnergy			
2,250 % éch. 12/07/2031	\$ 8 000	6 720	0,05
3,300 % éch. 12/07/2051	5 100	3 754	0,03
		10 474	0,08

CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Qatar National Bank QPSC			
5,966 % éch. 10/10/2023	4 600	4 600	0,04
Total Qatar		15 074	0,12

ROUMANIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement roumain			
1,375 % éch. 02/12/2029	€ 6 560	5 564	0,04
1,750 % éch. 13/07/2030	16 600	13 846	0,11
2,000 % éch. 28/01/2032	1 000	803	0,01
2,000 % éch. 14/04/2033	2 150	1 661	0,01
2,124 % éch. 16/07/2031 (i)	2 600	2 157	0,02
2,125 % éch. 07/03/2028	19 300	18 318	0,14
2,625 % éch. 02/12/2040	7 400	4 929	0,04
2,750 % éch. 14/04/2041	7 000	4 699	0,04
2,875 % éch. 13/04/2042	17 300	11 632	0,09
5,000 % éch. 27/09/2026	8 800	7 455	0,06
6,625 % éch. 27/09/2026	8 500	9 653	0,08
Total Roumanie		80 717	0,64

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ARABIE SAOUDITE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Saudi Arabian Oil Co.			
2,250 % éch. 24/11/2030	\$ 12 600	\$ 10 503	0,08
3,250 % éch. 24/11/2050	6 500	4 523	0,04
3,500 % éch. 24/11/2070	1 600	1 066	0,01
		16 092	0,13

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite			
3,250 % éch. 22/10/2030	\$ 3 100	2 817	0,02
4,750 % éch. 18/01/2028	32 400	32 163	0,25
4,875 % éch. 18/07/2033	33 500	33 507	0,27
5,000 % éch. 18/01/2053	2 700	2 505	0,02
		70 992	0,56
Total Arabie saoudite		87 084	0,69

SINGAPOUR			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.			
4,450 % éch. 19/05/2028	1 500	1 475	0,01
5,340 % éch. 19/05/2063	8 400	8 507	0,07
Total Singapour		9 982	0,08

SLOVÉNIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.			
1,875 % éch. 27/01/2025	€ 11 200	11 819	0,09
Nova Ljubljanska Banka d.d.			
3,400 % éch. 05/02/2030	3 500	3 246	0,03
3,650 % éch. 19/11/2029	8 300	7 697	0,06
Total Slovénie		22 762	0,18

CORÉE DU SUD			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen			
2,000 % éch. 10/06/2031	KRW 30 643 570	20 626	0,16
2,125 % éch. 10/06/2027	16 365 000	11 725	0,09
2,375 % éch. 10/12/2027	14 900 000	10 714	0,08
2,375 % éch. 10/12/2028	69 980 000	49 708	0,39
2,625 % éch. 10/06/2028	32 730 000	23 667	0,19
3,250 % éch. 10/06/2033	68 223 770	50 062	0,40
4,250 % éch. 10/12/2032	166 494 540	132 046	1,05
5,500 % éch. 10/03/2028	14 900 000	12 197	0,10
Total Corée du Sud		310 745	2,46

ESPAGNE			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS			
BBVA Consumer Auto			
0,270 % éch. 20/07/2031	€ 5 189	5 518	0,04
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Santander S.A.			
1,849 % éch. 25/03/2026	\$ 5 600	5 193	0,04
4,175 % éch. 24/03/2028	2 000	1 874	0,02
CaixaBank S.A.			
1,750 % éch. 24/10/2023	€ 10 400	11 272	0,09
		18 339	0,15

TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Fondo de Titulacion de Activos Santander Hipotecario			
3,325 % éch. 18/01/2049	389	419	0,00
Fondo de Titulacion de Activos UCI			
3,097 % éch. 15/09/2041	761	809	0,01
		1 228	0,01

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Communauté autonome de Catalogne			
4,220 % éch. 26/04/2035	3 900	4 224	0,03
Communauté autonome de Madrid			
1,571 % éch. 30/04/2029	1 300	1 279	0,01
Obligation internationale du gouvernement espagnol			
1,450 % éch. 31/10/2071	7 375	3 905	0,03
1,900 % éch. 31/10/2052	2 700	1 952	0,02

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
3,450 % éch. 30/07/2066	€ 53 300	\$ 53 029	0,42	Santander UK Group Holdings PLC				Southern Pacific Financing PLC			
5,250 % éch. 06/04/2029	£ 800	995	0,01	4,796 % éch. 15/11/2024	\$ 20 100	19 949	0,16	5,221 % éch. 10/03/2044	£ 542	\$ 679	0,01
		65 384	0,52	6,534 % éch. 10/01/2029	1 900	1 915	0,02	Stratton Mortgage Funding PLC			
Total Espagne		90 469	0,72	Santander UK PLC				5,391 % éch. 20/07/2060	41 687	53 004	0,42
				5,234 % éch. 12/02/2027	£ 16 900	21 517	0,17	5,765 % éch. 12/03/2052	15 710	19 903	0,16
SUPRANATIONALES				Standard Chartered PLC				Towd Point Mortgage Funding PLC			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				0,991 % éch. 12/01/2025	\$ 13 400	12 997	0,10	5,635 % éch. 20/10/2051	12 486	15 897	0,13
Banque européenne pour la reconstruction et le développement				1,822 % éch. 23/11/2025	28 100	26 287	0,21	5,841 % éch. 20/07/2045	21 156	26 909	0,21
0,500 % éch. 01/09/2023	AUD 5 400	3 571	0,03	2,608 % éch. 12/01/2028	12 700	11 256	0,09	Trinity Square PLC			
0,500 % éch. 21/12/2023	4 000	2 607	0,02	2,678 % éch. 29/06/2032	600	471	0,00	5,316 % éch. 15/07/2059	14 720	18 687	0,15
Banque européenne d'investissement				TP ICAP Finance PLC				Twin Bridges PLC			
0,500 % éch. 10/08/2023	10 200	6 763	0,05	2,625 % éch. 18/11/2028	£ 9 800	9 211	0,07	5,715 % éch. 12/03/2055	10 461	13 252	0,11
4,600 % éch. 30/01/2037	CAD 1 050	822	0,01			255 425	2,02	Uropa Securities PLC			
Banque interaméricaine de développement				TITRES ADRESSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS				4,729 % éch. 10/10/2040	53	65	0,00
2,500 % éch. 14/04/2027	AUD 15 200	9 396	0,07	PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				Warwick Finance Residential Mortgages PLC			
Total Supranationales		23 159	0,18	Alba PLC				0,000 % éch. 21/12/2049 (c)	1	5 914	0,05
				3,686 % éch. 15/12/2038	€ 97	101	0,00	5,865 % éch. 21/12/2049	33 599	42 513	0,34
SUÈDE				5,171 % éch. 15/12/2038	£ 4 450	5 414	0,04	6,564 % éch. 21/12/2049	7 280	9 168	0,07
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Avon Finance PLC				7,064 % éch. 21/12/2049	3 640	4 559	0,04
Molnlycke Holding AB				5,809 % éch. 20/09/2048	20 123	25 577	0,20	7,564 % éch. 21/12/2049	2 080	2 597	0,02
1,875 % éch. 28/02/2025	€ 400	419	0,00	Brass PLC				8,064 % éch. 21/12/2049	2 080	2 553	0,02
				5,430 % éch. 16/11/2066	4 372	5 574	0,04			449 982	3,57
SUISSE				Business Mortgage Finance PLC				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,822 % éch. 15/02/2041	5	7	0,00	Bon du Trésor britannique			
Credit Suisse AG				Canada Square Funding PLC				0,625 % éch. 22/10/2050	46 810	24 193	0,19
0,250 % éch. 05/01/2026	11 800	11 508	0,09	5,682 % éch. 17/06/2058	16 815	21 262	0,17	1,250 % éch. 31/07/2051	31 025	19 572	0,16
6,500 % éch. 08/08/2023 (g)	\$ 30 906	30 793	0,25	5,852 % éch. 17/06/2058	252	318	0,00	1,500 % éch. 31/07/2053	11 300	7 503	0,06
UBS Group AG				6,152 % éch. 17/12/2057	4 555	5 802	0,05			51 268	0,41
2,193 % éch. 05/06/2026	400	367	0,00	Eurohome UK Mortgages PLC				Total Royaume-Uni		757 184	6,00
2,875 % éch. 02/04/2032	€ 19 700	18 760	0,15	5,137 % éch. 15/06/2044	132	162	0,00				
3,091 % éch. 14/05/2032	\$ 27 800	22 499	0,18	Eurosail PLC				ÉTATS-UNIS			
3,869 % éch. 12/01/2029	12 550	11 356	0,09	3,629 % éch. 13/03/2045	€ 10	10	0,00	TITRES ADRESSÉS À DES ACTIFS			
4,194 % éch. 01/04/2031	1 600	1 425	0,01	3,709 % éch. 13/03/2045	400	418	0,00	Accredited Mortgage Loan Trust			
4,488 % éch. 12/05/2026	1 500	1 451	0,01	3,766 % éch. 15/12/2044	148	159	0,00	5,410 % éch. 25/09/2036	\$ 1 302	1 281	0,01
4,550 % éch. 17/04/2026	400	385	0,00	5,140 % éch. 13/03/2045	£ 52	65	0,00	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
6,373 % éch. 15/07/2026	900	895	0,01	5,690 % éch. 13/09/2045	866	1 089	0,01	5,270 % éch. 25/10/2036	4	2	0,00
6,442 % éch. 11/08/2028	30 600	30 738	0,24	5,940 % éch. 13/09/2045	49	61	0,00	5,410 % éch. 25/12/2036	6 042	3 317	0,03
6,537 % éch. 12/08/2033	5 700	5 843	0,05	Great Hall Mortgages PLC				5,450 % éch. 25/07/2036	2 155	801	0,01
7,375 % éch. 07/09/2033	£ 6 900	9 195	0,07	3,677 % éch. 18/03/2039	€ 237	256	0,00	5,945 % éch. 25/01/2035	710	649	0,01
7,750 % éch. 01/03/2029	€ 15 900	19 238	0,15	3,697 % éch. 18/06/2039	144	156	0,00	6,050 % éch. 25/12/2034	947	849	0,01
Total Suisse		164 453	1,30	5,262 % éch. 18/03/2038	£ 4 670	5 709	0,05	6,050 % éch. 25/08/2035	4 150	3 988	0,03
				5,644 % éch. 18/06/2039	\$ 46	46	0,00	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through			
ÉMIRATS ARABES UNIS				Ludgate Funding PLC				Certificats			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,212 % éch. 01/01/2061	€ 451	470	0,00	5,900 % éch. 25/01/2036	600	577	0,00
MDGH GMTN RSC Ltd.				Mansard Mortgages PLC				6,125 % éch. 25/07/2035	800	745	0,01
5,500 % éch. 28/04/2033	\$ 7 000	7 370	0,06	5,651 % éch. 15/12/2049	£ 5 743	7 154	0,06	6,200 % éch. 25/11/2034	630	617	0,01
				Newgate Funding PLC				Amortizing Residential Collateral Trust			
ROYAUME-UNI				3,704 % éch. 01/12/2050	€ 424	438	0,00	5,850 % éch. 25/10/2031	27	26	0,00
TITRES ADRESSÉS À DES ACTIFS				3,827 % éch. 01/12/2050	1 632	1 607	0,01	Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
PCL Funding PLC				4,126 % éch. 15/12/2050	655	689	0,01	6,090 % éch. 25/06/2029	41	39	0,00
5,469 % éch. 15/10/2025	£ 400	509	0,00	4,776 % éch. 15/12/2050	1 951	1 953	0,02	Argent Securities Trust			
				4,880 % éch. 01/12/2050	£ 502	609	0,01	5,450 % éch. 25/07/2036	6 152	5 246	0,04
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,026 % éch. 15/12/2050	€ 3 406	3 312	0,03	Asset-Backed Funding Certificates Trust			
AstraZeneca PLC				5,038 % éch. 01/12/2050	£ 604	727	0,01	5,850 % éch. 25/06/2034	236	229	0,00
5,995 % éch. 17/08/2023	\$ 400	400	0,00	5,078 % éch. 01/12/2050	362	429	0,00	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
Barclays PLC				6,005 % éch. 15/12/2050	2 449	2 987	0,02	5,765 % éch. 25/02/2036	2 325	2 258	0,02
3,125 % éch. 17/01/2024	£ 800	999	0,01	6,255 % éch. 15/12/2050	2 181	2 555	0,02	5,790 % éch. 25/12/2034	4	4	0,00
4,375 % éch. 12/01/2026	\$ 2 200	2 114	0,02	Paragon Mortgages PLC				5,810 % éch. 25/10/2032	3	2	0,00
6,467 % éch. 26/06/2024	AUD 4 000	2 684	0,02	5,541 % éch. 15/11/2038	\$ 23	22	0,00	6,150 % éch. 25/11/2042	18	18	0,00
Haleon UK Capital PLC				5,752 % éch. 15/05/2045	£ 2 799	3 561	0,03	6,155 % éch. 25/06/2035	1 412	1 352	0,01
3,125 % éch. 24/03/2025	\$ 16 600	15 868	0,13	Polaris PLC				6,200 % éch. 25/08/2037	2 140	1 796	0,01
HSBC Holdings PLC				5,631 % éch. 23/12/2058	6 008	7 604	0,06	Centex Home Equity Loan Trust			
2,848 % éch. 04/06/2031	9 900	8 220	0,06	Residential Mortgage Securities PLC				5,610 % éch. 25/07/2032	16	14	0,00
2,999 % éch. 10/03/2026	1 300	1 233	0,01	6,159 % éch. 20/06/2070	16 213	20 678	0,16	CIT Mortgage Loan Trust			
3,973 % éch. 22/05/2030	21 700	19 506	0,15	Resloc UK PLC				6,500 % éch. 25/10/2037	1 275	1 273	0,01
4,041 % éch. 13/03/2028	7 300	6 842	0,05	5,161 % éch. 15/12/2043	53	65	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust			
4,583 % éch. 19/06/2029	19 600	18 464	0,15	5,221 % éch. 15/12/2043	2 499	2 993	0,02	5,210 % éch. 25/07/2045	61	42	0,00
4,755 % éch. 09/06/2028	11 200	10 770	0,09	5,250 % éch. 15/12/2043	\$ 132	124	0,00	5,570 % éch. 25/01/2037	442	431	0,00
5,210 % éch. 11/08/2028	19 400	18 986	0,15	Ripon Mortgages PLC				5,764 % éch. 25/01/2037 ^	128	59	0,00
John Lewis PLC				5,491 % éch. 28/08/2056	£ 80 930	102 525	0,81	7,250 % éch. 25/05/2036	1 333	710	0,01
6,125 % éch. 21/01/2025	£ 100	122	0,00	RMAC Securities PLC				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
Lloyds Banking Group PLC				3,736 % éch. 12/06/2044	€ 848	875	0,01	5,540 % éch. 25/06/2037	3 157	3 110	0,02
4,650 % éch. 24/03/2026	\$ 1	1	0,00	5,134 % éch. 12/06/2044	£ 351	427	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates			
Nationwide Building Society				5,154 % éch. 12/06/2044	240	292	0,00	5,830 % éch. 25/12/2036 ^	119	87	0,00
2,972 % éch. 16/02/2028	8 800	7 913	0,06								
4,363 % éch. 01/08/2024	11 200	11 178	0,09								
NatWest Group PLC											
5,076 % éch. 27/01/2030	\$ 19 200	\$ 18 333	0,15								
NatWest Markets PLC											
1,000 % éch. 28/05/2024	€ 7 721	8 189	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
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				MASTR Asset-Backed Securities Trust				Soundview Home Loan Trust			
5,290 % éch. 25/06/2037	\$ 1 406	\$ 1 298	0,01	5,350 % éch. 25/08/2036	\$ 16 340	\$ 5 974	0,05	5,300 % éch. 25/03/2037	\$ 609	\$ 567	0,00
5,290 % éch. 25/07/2037	733	666	0,01	MASTR Specialized Loan Trust				5,320 % éch. 25/07/2037	1 867	1 533	0,01
5,290 % éch. 25/08/2037	981	968	0,01	6,800 % éch. 25/06/2043	198	200	0,00	5,320 % éch. 25/08/2037	247	209	0,00
5,350 % éch. 25/09/2047 ^	2 196	2 036	0,02	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				5,330 % éch. 25/07/2037	156	133	0,00
5,370 % éch. 25/08/2037	15 000	13 033	0,10	5,310 % éch. 25/09/2037	12	3	0,00	5,350 % éch. 25/06/2037	6 431	4 395	0,04
5,370 % éch. 25/09/2037 ^	437	439	0,00	5,870 % éch. 25/05/2036	206	203	0,00	5,360 % éch. 25/06/2037	12 404	8 353	0,07
5,370 % éch. 25/06/2047	12 504	11 881	0,09	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				5,555 % éch. 25/12/2036	6 330	6 151	0,05
5,470 % éch. 25/05/2047 ^	7 599	5 070	0,04	5,210 % éch. 25/05/2037	226	196	0,00	5,650 % éch. 25/10/2036	8 866	8 279	0,07
5,670 % éch. 25/12/2036 ^	5 670	5 313	0,04	5,280 % éch. 25/01/2037	2 649	1 215	0,01	5,650 % éch. 25/11/2036	5 415	5 027	0,04
5,670 % éch. 25/09/2046	3 570	3 393	0,03	5,290 % éch. 25/10/2036	3 052	1 328	0,01	5,900 % éch. 25/03/2036	955	931	0,01
5,810 % éch. 25/08/2035	1 847	1 786	0,01	5,380 % éch. 25/10/2036	10 237	5 423	0,04	6,050 % éch. 25/10/2037	5 198	4 103	0,03
5,840 % éch. 25/05/2036	2 482	2 443	0,02	5,400 % éch. 25/07/2036	486	419	0,00	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
5,990 % éch. 25/10/2047	2 645	2 513	0,02	5,470 % éch. 25/09/2036	4 342	1 943	0,02	4,460 % éch. 25/12/2036	258	242	0,00
6,125 % éch. 25/01/2036	4 680	4 533	0,04	5,650 % éch. 25/04/2036	4 570	4 221	0,03	Structured Asset Investment Loan Trust			
6,200 % éch. 25/11/2034	63	62	0,00	5,825 % éch. 25/09/2035	500	464	0,00	5,770 % éch. 25/01/2036	2 922	2 691	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				7,050 % éch. 25/02/2047	1 341	1 121	0,01	6,425 % éch. 25/11/2034	1 953	1 894	0,02
5,870 % éch. 25/07/2034	102	101	0,00	7,400 % éch. 25/03/2033	49	46	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				5,285 % éch. 25/07/2036	181	179	0,00
5,270 % éch. 25/02/2035	252	232	0,00	5,320 % éch. 25/04/2037	3 637	1 908	0,02	6,670 % éch. 25/04/2035	6	6	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				5,380 % éch. 25/04/2037	11 119	5 839	0,05	Terwin Mortgage Trust			
4,599 % éch. 25/01/2032	12	12	0,00	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				0,106 % éch. 25/08/2037 ^	211	58	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				5,200 % éch. 25/11/2036	2	1	0,00	6,090 % éch. 25/11/2033	5	4	0,00
5,270 % éch. 25/11/2036	31	15	0,00	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.			
CSAB Mortgage-Backed Trust				5,610 % éch. 25/02/2037	177	42	0,00	5,169 % éch. 01/04/2041	11 000	11 342	0,09
6,672 % éch. 25/06/2036 ^	206	63	0,00	5,750 % éch. 25/04/2037 ^	105	52	0,00	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust			
Delta Funding Home Equity Loan Trust				5,870 % éch. 25/04/2037	296	87	0,00	5,300 % éch. 25/01/2037	2 667	2 198	0,02
5,833 % éch. 15/08/2030	9	9	0,00	6,000 % éch. 25/02/2037 ^	135	78	0,00	Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust			
Ellington Loan Acquisition Trust				New Century Home Equity Loan Trust				3,911 % éch. 25/10/2036	49	18	0,00
6,250 % éch. 25/01/2037	309	296	0,00	3,720 % éch. 20/06/2031	171	151	0,00	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
EMC Mortgage Loan Trust				Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				5,495 % éch. 25/01/2037	5 276	5 054	0,04
5,890 % éch. 25/05/2040	13	12	0,00	5,780 % éch. 25/02/2036	4 100	3 640	0,03				
Encore Credit Receivables Trust				Nomura Resecuritization Trust							
6,050 % éch. 25/01/2036	6 000	5 647	0,04	3,581 % éch. 26/12/2037	991	842	0,01				
Fieldstone Mortgage Investment Trust				NovaStar Mortgage Funding Trust				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
5,378 % éch. 25/11/2036	2 029	1 181	0,01	5,490 % éch. 25/01/2037	1 376	482	0,00	7-Eleven, Inc.			
First Franklin Mortgage Loan Trust				5,690 % éch. 25/05/2036	3 600	3 368	0,03	0,800 % éch. 10/02/2024	12 300	11 924	0,10
5,260 % éch. 25/12/2037	2 568	2 409	0,02	5,810 % éch. 25/01/2036	150	148	0,00	AbbVie, Inc.			
5,870 % éch. 25/10/2035	16	16	0,00	Option One Mortgage Loan Trust				1,500 % éch. 15/11/2023	€ 1 200	1 298	0,01
Fremont Home Loan Trust				5,290 % éch. 25/01/2037	732	477	0,00	Ally Financial, Inc.			
5,285 % éch. 25/10/2036	2 227	1 961	0,02	5,290 % éch. 25/03/2037	2 786	2 133	0,02	8,000 % éch. 01/11/2031	\$ 300	312	0,00
5,290 % éch. 25/01/2037	2 385	1 212	0,01	5,330 % éch. 25/04/2037	14 542	7 290	0,06	American Tower Corp.			
6,215 % éch. 25/06/2035	5 290	5 012	0,04	5,370 % éch. 25/04/2037	3 870	2 760	0,02	2,950 % éch. 15/01/2025	14 600	13 971	0,11
GSAA Home Equity Trust				5,370 % éch. 25/05/2037	4 826	2 847	0,02	3,800 % éch. 15/08/2029	7 400	6 760	0,05
5,610 % éch. 25/04/2047	311	152	0,00	5,830 % éch. 25/11/2034	49	46	0,00	Aviation Capital Group LLC			
5,630 % éch. 25/06/2036	2 835	889	0,01	5,885 % éch. 25/08/2035	26	26	0,00	4,125 % éch. 01/08/2025	23 600	22 057	0,18
5,750 % éch. 25/03/2037	289	122	0,00	6,020 % éch. 25/05/2035	4 867	3 966	0,03	Bank of America Corp.			
5,750 % éch. 25/05/2047	112	75	0,00	Ownit Mortgage Loan Trust				1,949 % éch. 27/10/2026	€ 17 600	18 070	0,14
GSAMP Trust				5,438 % éch. 25/05/2037	1 590	1 208	0,01	3,384 % éch. 02/04/2026	\$ 11 800	11 317	0,09
5,280 % éch. 25/12/2046	8 060	4 387	0,03	Park Place Securities, Inc.				4,412 % éch. 24/08/2025	€ 15 400	16 867	0,13
5,290 % éch. 25/12/2036	5 903	3 194	0,03	5,885 % éch. 25/09/2035	183	178	0,00	4,587 % éch. 22/09/2026	€ 6 200	6 750	0,05
5,380 % éch. 25/12/2046	7 062	3 557	0,03	People's Choice Home Loan Securities Trust				\$ 27 100	26 821	0,21	
5,430 % éch. 25/06/2036	134	129	0,00	6,500 % éch. 25/01/2035	122	115	0,00	Bayer U.S. Finance LLC			
5,650 % éch. 25/05/2046	475	446	0,00	Renaissance Home Equity Loan Trust				4,250 % éch. 15/12/2025	5 700	5 502	0,04
5,825 % éch. 25/11/2035	2 587	2 452	0,02	5,340 % éch. 25/01/2037	15 587	5 479	0,04	6,562 % éch. 15/12/2023	10 200	10 190	0,08
Home Equity Asset Trust				5,850 % éch. 25/08/2032	1	1	0,00	British Airways Pass-Through Trust			
5,710 % éch. 25/08/2036	353	343	0,00	5,879 % éch. 25/06/2037 ^	19 229	5 777	0,05	3,300 % éch. 15/06/2034	5 444	4 733	0,04
6,070 % éch. 25/02/2033	2	2	0,00	5,893 % éch. 25/06/2037 ^	9 958	2 999	0,02	Broadcom, Inc.			
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				Residential Asset Mortgage Products Trust				2,450 % éch. 15/02/2031	8 300	6 754	0,05
5,310 % éch. 25/11/2036	6 366	5 419	0,04	5,590 % éch. 25/12/2036	576	557	0,00	Charter Communications Operating LLC			
5,470 % éch. 25/04/2037	3 183	2 708	0,02	5,830 % éch. 25/12/2035	3 636	3 154	0,03	3,750 % éch. 15/02/2028	10 900	9 998	0,08
Home Equity Mortgage Trust				Residential Asset Securities Corp. Trust				3,850 % éch. 01/04/2061	5 100	3 089	0,02
6,000 % éch. 25/01/2037 ^	484	442	0,00	5,855 % éch. 25/11/2035	600	573	0,00	4,500 % éch. 01/02/2024	3 800	3 767	0,03
HSI Asset Securitization Corp. Trust				Saxon Asset Securities Trust				5,125 % éch. 01/07/2049	600	473	0,00
5,690 % éch. 25/02/2036	2 202	2 158	0,02	5,350 % éch. 25/05/2047	8 125	7 042	0,06	6,384 % éch. 23/10/2035	6 000	5 852	0,05
Humboldt Americas LLC				5,460 % éch. 25/09/2037	2 159	2 038	0,02	6,949 % éch. 01/02/2024	7 700	7 733	0,06
0,000 % éch. 31/07/2022	COP 20 000 000	4 722	0,04	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				Citigroup, Inc.			
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				5,250 % éch. 25/12/2036	6	3	0,00	3,290 % éch. 17/03/2026 (h)	33 100	31 674	0,25
5,370 % éch. 25/08/2036	\$ 2 777	1 981	0,02	5,270 % éch. 25/12/2036 ^	82	19	0,00	Corebridge Financial, Inc.			
5,410 % éch. 25/08/2036	443	438	0,00	5,280 % éch. 25/05/2037 ^	149	112	0,00	3,500 % éch. 04/04/2025	7 500	7 150	0,06
5,420 % éch. 25/08/2036	8 000	7 123	0,06	5,870 % éch. 25/10/2035	523	419	0,00	Credit Suisse AG AT1 Claim ^	1 200	48	0,00
5,630 % éch. 25/04/2036	5 267	4 958	0,04	5,975 % éch. 25/10/2035	2 208	1 975	0,02	Dell International LLC			
Lehman ABS Mortgage Loan Trust				SG Mortgage Securities Trust				6,020 % éch. 15/06/2026	2 700	2 746	0,02
5,240 % éch. 25/06/2037	89	58	0,00	5,470 % éch. 25/07/2036	3 133	674	0,01	Doctors Co. An Interinsurance Exchange			
Long Beach Mortgage Loan Trust				SLM Student Loan Trust				4,500 % éch. 18/01/2032	3 900	3 097	0,03
5,450 % éch. 25/05/2036	3 759	2 187	0,02	3,661 % éch. 25/10/2039	€ 160	163	0,00	Energy Transfer LP			
5,710 % éch. 25/10/2034	538	500	0,00	4,076 % éch. 15/12/2033	900	906	0,01	4,500 % éch. 15/04/2024	1 300	1 285	0,01
6,425 % éch. 25/02/2035	7 161	6 909	0,05								

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
5,610 % éch. 25/05/2035	\$ 399	\$ 338	0,00	4,826 % éch. 19/12/2036 ^	\$ 290	\$ 247	0,00	MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust	\$ 3 983	\$ 3 239	0,03
5,730 % éch. 25/04/2035	185	171	0,00	5,347 % éch. 19/09/2037	495	434	0,00	5,610 % éch. 25/06/2047	3 983	3 239	0,03
5,730 % éch. 25/04/2035	11	9	0,00	5,546 % éch. 19/09/2046 ^	566	523	0,01	New Century Alternative Mortgage Loan Trust	4 907	1 177	0,01
5,750 % éch. 25/07/2037 ^	323	169	0,00	5,567 % éch. 19/12/2036	8 609	7 194	0,06	6,173 % éch. 25/07/2036	4 907	1 177	0,01
5,790 % éch. 25/03/2035	1 083	943	0,01	5,626 % éch. 19/03/2036 ^	117	107	0,00	New Residential Mortgage Loan Trust	2 177	2 042	0,02
5,810 % éch. 25/02/2035	222	203	0,00	5,657 % éch. 19/01/2036	319	198	0,00	3,500 % éch. 25/12/2057	2 177	2 042	0,02
5,830 % éch. 25/02/2035	90	77	0,00	5,857 % éch. 19/01/2035	89	79	0,00	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust	29	17	0,00
5,850 % éch. 25/02/2036 ^	7	3	0,00	5,976 % éch. 19/10/2035	379	213	0,00	3,834 % éch. 25/10/2035	29	17	0,00
5,910 % éch. 25/09/2034	23	22	0,00	6,657 % éch. 19/10/2035	229	153	0,00	NovaStar Mortgage Funding Trust	1 323	463	0,00
5,910 % éch. 20/02/2036 ^	12	10	0,00	HomeBanc Mortgage Trust	1	1	0,00	0,440 % éch. 25/09/2046	1 323	463	0,00
5,910 % éch. 20/02/2036 ^	21	18	0,00	5,510 % éch. 25/12/2036	1	1	0,00	Residential Accredited Loans, Inc. Trust	39	15	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036	293	159	0,00	HSI Asset Loan Obligation Trust	34	30	0,00	3,923 % éch. 25/08/2035 ^	39	15	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037	1 063	511	0,01	6,000 % éch. 25/06/2037 ^	34	30	0,00	4,165 % éch. 25/06/2046	4 580	1 116	0,01
6,500 % éch. 25/12/2037	672	295	0,00	Impac CMB Trust	6	6	0,00	5,091 % éch. 25/11/2037	1 664	1 388	0,01
6,500 % éch. 25/11/2047	508	275	0,00	5,790 % éch. 25/03/2035	6	6	0,00	5,300 % éch. 25/02/2047	405	153	0,00
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust	617	551	0,01	6,150 % éch. 25/07/2033	4	4	0,00	5,450 % éch. 25/06/2037 ^	1 056	939	0,01
5,510 % éch. 25/03/2035 ^	37	3	0,00	Impac Secured Assets Trust	3 991	3 195	0,03	5,470 % éch. 25/03/2047	1 510	1 360	0,01
6,000 % éch. 25/03/2035 ^	44	41	0,00	5,670 % éch. 25/01/2037	41	38	0,00	5,570 % éch. 25/04/2046	3 480	1 028	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.	3	3	0,00	IndyMac Mortgage Loan Trust	41	38	0,00	5,650 % éch. 25/08/2037	492	449	0,00
5,493 % éch. 25/03/2032	37	34	0,00	3,093 % éch. 25/01/2036 ^	98	78	0,00	6,000 % éch. 25/06/2036	365	291	0,00
6,500 % éch. 25/04/2033	3	3	0,00	3,281 % éch. 25/10/2035	474	325	0,00	Residential Asset Securitization Trust	11	3	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates	6	5	0,00	3,327 % éch. 25/03/2036	155	124	0,00	5,550 % éch. 25/01/2046 ^	1 791	1 381	0,01
4,260 % éch. 25/07/2033	6	5	0,00	3,367 % éch. 25/06/2036	1 864	1 320	0,01	5,750 % éch. 25/02/2036	1 129	596	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust	66	18	0,00	3,438 % éch. 25/03/2036 ^	90	69	0,00	5,750 % éch. 25/04/2037 ^	773	335	0,00
6,079 % éch. 25/04/2037 ^	66	18	0,00	3,482 % éch. 25/08/2035 ^	48	46	0,00	6,000 % éch. 25/07/2037 ^	1 089	328	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Trust	4 582	3 845	0,03	3,916 % éch. 25/12/2034	1 489	1 325	0,01	6,500 % éch. 25/08/2036 ^	223	144	0,00
3,474 % éch. 25/06/2050	9 181	8 614	0,07	5,510 % éch. 25/02/2037 ^	899	720	0,01	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust	7	7	0,00
3,850 % éch. 25/09/2057	1 120	1 043	0,01	5,550 % éch. 25/06/2046	111	100	0,00	4,149 % éch. 25/09/2035 ^	223	144	0,00
DBGS Mortgage Trust	1 120	1 043	0,01	5,630 % éch. 25/06/2037	21 560	64	0,00	6,500 % éch. 25/03/2032	7	7	0,00
6,038 % éch. 15/06/2033	1 575	1 425	0,01	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust	683	509	0,01	Sequoia Mortgage Trust	262	173	0,00
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust	1 708	1 611	0,01	0,719 % éch. 15/04/2047 (a)	12	6	0,00	3,271 % éch. 20/01/2047 ^	624	504	0,01
5,390 % éch. 25/08/2036 ^	2 706	2 304	0,02	JP Morgan Alternative Loan Trust	2 861	2 555	0,02	3,723 % éch. 20/07/2037	29	28	0,00
5,450 % éch. 25/03/2037 ^	2 715	2 303	0,02	4,667 % éch. 25/12/2035 ^	140	101	0,00	4,601 % éch. 20/04/2035	21	20	0,00
5,450 % éch. 25/09/2047 ^	3 467	2 839	0,02	5,500 % éch. 25/11/2036 ^	56	51	0,00	5,846 % éch. 19/10/2026	121	110	0,00
5,480 % éch. 25/08/2037 ^	8	8	0,00	5,630 % éch. 25/10/2036	177	165	0,00	5,857 % éch. 20/07/2033	2	2	0,00
5,530 % éch. 25/08/2047	8	8	0,00	5,660 % éch. 25/06/2037	133	99	0,00	5,917 % éch. 20/10/2027	2	2	0,00
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust	6	5	0,00	JP Morgan Mortgage Trust	82	80	0,00	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust	44	39	0,00
2,907 % éch. 25/10/2035	6	5	0,00	3,854 % éch. 25/11/2033	84	81	0,00	3,525 % éch. 25/11/2035 ^	758	651	0,01
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust	1 238	1 027	0,01	3,963 % éch. 25/12/2034	403	315	0,00	4,045 % éch. 25/07/2035 ^	92	80	0,00
2,907 % éch. 25/10/2035	30	27	0,00	4,000 % éch. 25/02/2036 ^	210	156	0,00	4,222 % éch. 25/08/2035	388	286	0,00
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust	167	73	0,00	4,018 % éch. 25/08/2034	36	34	0,00	4,974 % éch. 25/12/2035	169	161	0,00
5,347 % éch. 19/10/2036	77	75	0,00	4,047 % éch. 25/07/2035	403	315	0,00	4,984 % éch. 25/09/2034	4	4	0,00
5,997 % éch. 19/09/2044	157	53	0,00	4,121 % éch. 25/02/2036 ^	210	156	0,00	5,227 % éch. 25/09/2034	47	44	0,00
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust	167	73	0,00	4,282 % éch. 25/06/2036 ^	36	34	0,00	5,282 % éch. 25/02/2034	354	324	0,00
5,024 % éch. 25/04/2035	77	75	0,00	4,319 % éch. 25/07/2035	2 509	2 434	0,02	5,470 % éch. 25/10/2035	9	8	0,00
6,250 % éch. 25/11/2036 ^	167	73	0,00	Lehman XS Trust	228	389	0,00	5,590 % éch. 25/05/2037	47	45	0,00
6,250 % éch. 25/08/2037 ^	51	37	0,00	5,510 % éch. 25/05/2046	208	190	0,00	5,701 % éch. 25/04/2034	2 399	1 975	0,02
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust	287	246	0,00	Luminent Mortgage Trust	361	322	0,00	3,547 % éch. 25/05/2047 ^	1 520	1 319	0,01
4,715 % éch. 25/08/2035	50	47	0,00	5,510 % éch. 25/12/2036 ^	81	77	0,00	5,270 % éch. 25/08/2036	1 970	1 750	0,02
Greenpoint Mortgage Funding Trust	188	179	0,00	5,550 % éch. 25/10/2046	677	68	0,00	5,330 % éch. 25/01/2037	1 512	1 386	0,01
5,510 % éch. 25/01/2037	67	59	0,00	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust	152	101	0,00	5,330 % éch. 25/09/2047	22	19	0,00
5,570 % éch. 25/04/2036	1 019	832	0,01	4,560 % éch. 21/11/2034	47	45	0,00	5,370 % éch. 25/09/2047	1 116	985	0,01
5,590 % éch. 25/06/2045	1 279	934	0,01	MASTR Alternative Loan Trust	5 893	5 000	0,04	5,376 % éch. 25/12/2035 ^	1 183	1 065	0,01
5,590 % éch. 25/06/2045	6	6	0,00	5,550 % éch. 25/03/2036 ^	47	45	0,00	5,470 % éch. 25/01/2037	42	40	0,00
5,690 % éch. 25/04/2036 ^	6	6	0,00	MASTR Asset Securitization Trust	17	17	0,00	5,476 % éch. 25/08/2047 ^	2 397	2 092	0,02
5,690 % éch. 25/11/2045	6	6	0,00	6,000 % éch. 25/06/2036 ^	43	41	0,00	5,530 % éch. 25/06/2036	444	299	0,00
5,690 % éch. 25/09/2046 ^	6	6	0,00	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates	43	41	0,00	5,550 % éch. 25/10/2036	2 133	1 767	0,02
5,830 % éch. 25/10/2046 ^	6	6	0,00	5,632 % éch. 20/10/2029	17	17	0,00	5,570 % éch. 25/05/2036	2 298	1 843	0,02
GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates	5 000	4 405	0,04	5,633 % éch. 15/12/2030	8 769	2 748	0,02	5,590 % éch. 25/05/2046	2 467	858	0,01
4,725 % éch. 25/10/2033	51	10	0,00	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust	136	128	0,00	5,646 % éch. 19/07/2035	28	27	0,00
GS Mortgage Securities Corp. Trust	36	34	0,00	5,470 % éch. 25/01/2037	15	14	0,00	5,670 % éch. 25/05/2046 ^	47	28	0,00
6,343 % éch. 15/07/2031	20	19	0,00	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust	65	61	0,00	5,710 % éch. 25/02/2036 ^	293	247	0,00
GSMSC Pass-Through Trust	14	14	0,00	Merrill Lynch Mortgage Securities Trust	12	11	0,00	5,726 % éch. 19/07/2034	22	20	0,00
7,500 % éch. 25/10/2036	9 822	5 038	0,04	4,015 % éch. 25/12/2034	12	11	0,00	5,806 % éch. 19/09/2032	18	17	0,00
GSR Mortgage Loan Trust	115	142	0,00	4,229 % éch. 25/06/2037	724	646	0,01	5,846 % éch. 19/03/2034	4	4	0,00
3,935 % éch. 25/01/2036 ^	0	0	0,00	4,386 % éch. 25/02/2033	8 100	7 693	0,06	Structured Asset Securities Corp.	514	431	0,00
4,070 % éch. 25/09/2035	20	19	0,00	5,810 % éch. 25/06/2028	479	318	0,00	5,430 % éch. 25/01/2036	514	431	0,00
4,234 % éch. 25/06/2034	20	19	0,00	Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust	24	18	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust	27	7	0,00
4,481 % éch. 25/11/2035	76	63	0,00	3,673 % éch. 25/04/2037 ^	8 100	7 693	0,06	5,440 % éch. 25/10/2036	27	7	0,00
5,380 % éch. 25/05/2037	51	37	0,00	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust	151	141	0,00	TBW Mortgage-Backed Trust	18	17	0,00
5,500 % éch. 25/01/2037	41	38	0,00	3,732 % éch. 15/05/2048	479	318	0,00	6,130 % éch. 25/01/2037 ^	558	512	0,01
6,000 % éch. 25/03/2032	51	37	0,00	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust	24	18	0,00	3,018 % éch. 25/09/2037	1 267	1 059	0,01
6,780 % éch. 25/03/2033	41	38	0,00	3,103 % éch. 25/11/2037	151	141	0,00	6,400 % éch. 25/06/2037 ^	1 486	1 267	0,01
6,970 % éch. 25/04/2032	41	38	0,00	3,647 % éch. 25/11/2035 ^	151	141	0,00	7,101 % éch. 25/06/2037	1 486	1 267	0,01
HarborView Mortgage Loan Trust	41	38	0,00	5,410 % éch. 25/04/2035	151	141	0,00	7,151 % éch. 25/06/2037	990	869	0,01
4,201 % éch. 19/07/2035 ^	41	38	0,00					7,151 % éch. 25/06/2047 ^	990	869	0,01
4,688 % éch. 19/08/2036 ^	41	38	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
BONS DU TRÉSOR ISRAËLIEN				(0,176) % éch.				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds UK Corporate Bond Fund (f)			
1,716 % éch.				14/08/2023 (c)(d)	¥ 7 111 000	49 206	0,39				
05/07/2023 (c)(d)	ILS	18 700 \$	5 036	0,168) % éch.					7 715 431	\$ 82 690	0,65
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				10/07/2023 (c)(d)	8 190 000	56 666	0,45	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (f)			
(0,211) % éch.				(0,163) % éch.	42 739 000	295 751	2,34		336 429	3 378	0,03
24/07/2023 (c)(d)	¥	10 929 000	75 620	(0,152) % éch.	13 957 000	96 593	0,76	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)			
(0,206) % éch.				(0,132) % éch.	22 423 000	155 185	1,23		17 941 969	178 665	1,42
18/07/2023 (c)(d)		22 054 000	152 594			2 615 911	20,74	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (f)			
(0,202) % éch.				Total des Instruments à court terme		2 729 773	21,64		345 274	4 500	0,04
28/08/2023 (c)(d)		9 595 000	66 398	Total des Valeurs mobilières	\$ 14 608 940	115,83			440 492	3,49	
(0,200) % éch.				ACTIONS							
14/08/2023 (c)(d)		19 909 000	137 765	FONDS D'INVESTISSEMENT							
(0,200) % éch.				ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF							
28/08/2023 (c)(d)		17 494 000	121 060	FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE							
(0,199) % éch.				PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)							
11/09/2023 (c)(d)		3 981 000	27 550	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)							
(0,189) % éch.				Total des Fonds d'investissement							
28/08/2023 (c)(d)		9 075 000	62 800	\$ 1 249 595 9,91							
(0,188) % éch.											
18/07/2023 (c)(d)		29 186 000	201 941								
(0,188) % éch.											
28/08/2023 (c)(d)		26 396 000	182 663								
(0,187) % éch.											
10/07/2023 (c)(d)		20 140 000	139 347								
(0,187) % éch.											
21/08/2023 (c)(d)		22 611 000	156 466								
(0,184) % éch.											
04/09/2023 (c)(d)		46 240 000	319 993								
(0,183) % éch.											
21/08/2023 (c)(d)		39 310 000	272 022								
(0,182) % éch.											
24/07/2023 (c)(d)		5 801 000	40 139								
(0,179) % éch.											
11/09/2023 (c)(d)		889 000	6 152								

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	5,110 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 127 200	Billets du Trésor américain 2,625 % échéance 15/04/2025	\$ (129 709)	\$ 127 200	\$ 127 254	1,01	
BRC	5,120	30/06/2023	03/07/2023	593 800	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/05/2025	(605 974)	593 800	594 053	4,71	
	5,130	30/06/2023	03/07/2023	100	Ginnie Mae 2,500 % échéance 20/08/2051	(102)	100	100	0,00	
Total des Contrats de mise en pension							\$ (735 785)	\$ 721 100	\$ 721 407	5,72

(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	2 638	\$ 7 010	0,05
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	1 273	452	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Long	06/2024	1 273	(288)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre	Court	09/2023	1 037	401	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Court	09/2023	1 351	642	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre	Court	09/2023	4	6	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	6 617	12 223	0,09
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	319	(349)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	2 884	3 212	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	75	95	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Long	09/2023	17	38	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Court	09/2023	5 108	1 832	0,01
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	9 056	2 119	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	76	(278)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	50	(107)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	2 194	(4 317)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	643	818	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	36	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	33	(65)	0,00
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	1 501	446	0,00
				\$ 23 888	0,19

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	295	\$ (129)	\$ (111)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	295	(103)	(15)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	98,000	15/12/2023	222	0	(11)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	222	0	(1 046)	(0,01)
				\$ (232)	\$ (1 183)	(0,01)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					\$ 22 705	0,18

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 %	20/12/2023	\$ 5 900	\$ (58)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2026	800	38	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20/06/2026	€ 17 500	(947)	(0,01)
				\$ (967)	(0,01)

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-39 à 10 ans	(1,000) %	20/12/2032	\$ 2 060	\$ (11)	0,00
Indice CDX.IG-40 à 10 ans	(1,000)	20/06/2033	801 370	(9 046)	(0,07)
				\$ (9 057)	(0,07)

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 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	\$ 103 500	\$ 933	0,01
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	1 112 600	8 065	0,06
Indice iTraxx Europe Main 39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	€ 53 000	139	0,00
				\$ 9 137	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 ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250 %	20/09/2053	£ 27 400	\$ (2 476)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	787 110	(39 469)	(0,31)
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	64 200	(4 096)	(0,03)
À recevoir ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	119 200	4 386	0,03
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	16/03/2032	INR 1 997 200	(1 051)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	15/03/2028	3 212 810	319	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	17/03/2031	¥ 14 710 000	(2 550)	(0,02)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	19 820 000	(180)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,200	19/06/2029	6 440 000	(1 586)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	19/06/2039	13 160 000	6 788	0,05
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,450	15/12/2051	770 000	(67)	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	3 460 000	1 365	0,01
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,000	15/03/2028	SGD 47 830	(906)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	15/07/2023	\$ 578 050	7 814	0,06
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	25/08/2023	155 100	(2 152)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	31/08/2023	178 000	(2 474)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,400	15/01/2028	578 050	(91 394)	(0,72)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	16 880	(813)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,249	31/08/2024	178 000	8 660	0,07
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2026	444 500	47 347	0,38
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,298	25/08/2024	155 100	7 544	0,06
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,360	17/09/2024	53 950	2 140	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,430	31/03/2024	256 050	(9 936)	(0,08)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,488	15/08/2031	25 600	(4 403)	(0,04)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/12/2028	233 690	(30 907)	(0,25)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,518	20/01/2029	17 800	(2 201)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,545	20/01/2029	3 000	(367)	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 ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630	20/01/2029	\$ 63 600	\$ (7 515)	(0,06)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630	26/01/2029	14 700	(1 725)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	610 261	7 769	0,06
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2025	6 500	7	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	632 731	16 152	0,13
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	35 650	(1 146)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	15/12/2051	66 000	(22 984)	(0,18)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	6 600	114	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	74 840	(2 075)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,965	30/11/2026	565 100	28 324	0,22
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	71 300	1 468	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	34 180	(381)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	11 300	(487)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	31 000	(1 242)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,100	15/11/2032	42 410	(1 558)	(0,01)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,150	13/05/2025	1 265 400	12 333	0,10
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,163	30/09/2029	37 000	(1 390)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,165	03/10/2053	16 700	52	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,200	13/05/2025	78 400	887	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,225	30/09/2029	5 200	(195)	0,00
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,240	03/10/2053	16 700	287	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	27 300	619	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	16 280	(294)	0,00
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	20/12/2053	59 700	214	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,300	31/05/2027	100 800	2 783	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,300	14/06/2033	34 000	(602)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,425	01/03/2033	12 510	(161)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,445	03/10/2038	55 400	18	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,454	30/06/2029	82 000	(1 454)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	15 800	(265)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/06/2030	32 300	(288)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2030	2 800	27	0,00
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2033	84 008	(617)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	16 200	(224)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,533	03/10/2038	55 400	(540)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	21/06/2025	186 000	2 986	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	20/12/2028	244 593	2 111	0,02
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,752	03/10/2028	71 600	(112)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	10 300	(85)	0,00
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,850	03/10/2028	71 600	198	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,898	30/06/2029	66 300	381	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,159	31/03/2025	214 600	3 516	0,03
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,250	20/12/2025	838 819	4 418	0,03
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,409	04/10/2024	300 600	(3 778)	(0,03)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,409	04/10/2024	300 600	3 927	0,03
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,427	27/09/2024	350 000	(4 183)	(0,03)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,427	27/09/2024	350 000	3 566	0,03
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,433	06/09/2024	611 900	(7 399)	(0,06)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,433	06/09/2024	611 900	6 391	0,05
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,789	07/03/2024	110 900	(891)	(0,01)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,789	07/03/2024	110 900	489	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,235	04/03/2025	CAD 57 400	(3 369)	(0,03)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2025	89 200	(3 708)	(0,03)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	207 300	(21 113)	(0,17)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,713	02/10/2029	81 100	(7 994)	(0,06)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,900	18/12/2029	107 300	(10 663)	(0,08)
À recevoir	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,500	28/01/2052	700	5	0,00
À recevoir	Bon bancaire en CAD à 3 mois	3,250	15/03/2033	88 700	3 226	0,03
À payer	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,250	21/06/2033	101 600	440	0,00
À recevoir	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,250	21/06/2053	11 000	12	0,00
À payer ⁽⁴⁾	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,500	10/05/2025	1 745 300	(10 656)	(0,08)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,283	14/02/2027	CHF 47 000	(3 167)	(0,03)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,294	10/02/2027	19 900	(1 288)	(0,01)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,343	16/05/2027	31 300	(2 059)	(0,02)
À payer	CNREPOFIX CNY 3 mois	2,500	16/03/2027	CNY 382 500	542	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY 3 mois	2,500	21/12/2027	21 700	(36)	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY 3 mois	2,500	21/12/2027	21 700	36	0,00
À payer	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,000	23/11/2024	€ 259 600	(4 745)	(0,04)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2028	KRW 693 114 366	(9 580)	(0,08)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2033	38 398 724	87	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	20/09/2033	76 861 620	169	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	0,110	16/12/2023	NZD 600	(9)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	0,528	17/03/2024	10 000	(227)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	15/12/2023	354 250	(2 910)	(0,02)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,750	15/06/2027	102 300	(1 616)	(0,01)
À payer	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024	624 400	(5 001)	(0,04)
À payer ⁽⁴⁾	BBR NZD à 3 mois	5,000	20/03/2025	324 700	(504)	0,00
À payer ⁽⁴⁾	BBR NZD à 3 mois	5,250	20/03/2025	15 800	(11)	0,00
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	0,500	19/06/2024	SEK 260 100	(1 463)	(0,01)
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	1,000	19/06/2029	56 700	(848)	(0,01)
À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	15/03/2028	THB 4 091 920	1 380	0,01

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 payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	15/07/2023	\$ 578 050	\$ (7 752)	(0,06)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	25/08/2023	155 100	2 145	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	31/08/2023	178 000	2 496	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/09/2023	444 500	4 916	0,04
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	17/09/2023	53 950	375	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/09/2023	233 690	(2 439)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/07/2023	17 800	(103)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,545	20/07/2023	3 000	(17)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	20/07/2023	63 600	(331)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/07/2023	14 700	(77)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/09/2023	66 000	(606)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,409	04/07/2023	300 600	645	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,409	04/07/2023	300 600	(650)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,427	27/07/2023	350 000	(875)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,427	27/09/2023	350 000	1 083	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,433	06/07/2023	611 900	(267)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,433	06/09/2023	611 900	1 813	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,789	07/07/2023	110 900	(14)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,789	07/09/2023	110 900	234	0,00
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,250	17/06/2030	AUD 128 300	18 826	0,15
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/03/2027	92 600	(5 565)	(0,04)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,000	21/06/2033	123 700	(3 207)	(0,03)
À payer ⁽⁴⁾	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/09/2032	40 100	(173)	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/03/2033	206 600	(4 326)	(0,03)
À payer ⁽⁴⁾	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,500	15/09/2032	663 500	909	0,01
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,913	30/01/2029	CZK 158 300	(1 040)	(0,01)
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	0,054	27/05/2050	€ 7 450	3 349	0,03
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,064	17/11/2052	17 650	9 673	0,08
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	12 500	(559)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	34 400	(3 653)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	24 400	(2 540)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	19 200	(2 013)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	30/03/2024	76 900	(1 967)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	41 000	(3 846)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	18 100	(1 697)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	11/04/2024	103 300	(1 618)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	13/04/2024	218 700	(3 421)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	17/05/2024	55 200	(934)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	26/04/2024	32 200	(447)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	38 500	(573)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	32 900	(492)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037	55 870	(2 153)	(0,02)
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	371 000	(2 383)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	19/03/2027	489 180	(3 510)	(0,03)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	1 385 700	(5 465)	(0,04)
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	15/03/2033	221 155	(595)	0,00
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	1 691 300	5 269	0,04
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	430 700	(4 186)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,870	07/07/2025	MXN 393 200	(2 152)	(0,02)
					\$ (178 202)	(1,41)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (179 089)	(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) 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.

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 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,180 %	11/01/2024	49 700	\$ 1 420	\$ 5 103	0,04

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 hors cote, 0,750 % échéance 25/05/2052	€ 97,000	23/05/2025	26 800	\$ 2 027	\$ 11 170	0,09

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 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	31 200	\$ (97)	\$ (3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	31 200	(97)	(422)	(0,01)
	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	(1 425)	(10 683)	(0,09)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,380	31/07/2023	17 200	(66)	(82)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	17 200	(66)	(51)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	3 100	(20)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	3 100	(20)	(2)	0,00
BPS	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)	(10 259)	(0,08)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	3 600	(25)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	3 600	(25)	0	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	17 000	(55)	(34)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	17 000	(55)	(82)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	5 900	(14)	(11)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	5 900	(14)	(21)	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	33 700	(265)	(40)	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)	(620)	(0,01)
DUB	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	19 700	(119)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	19 700	(119)	(423)	(0,01)
	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)	(51)	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	39 000	(300)	(678)	(0,01)
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	14 400	(113)	(17)	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	14 400	(113)	(265)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	6 800	(47)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	6 800	(47)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,100	31/08/2023	29 300	(215)	(42)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	31/08/2023	29 300	(215)	(298)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	12 100	(74)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	12 100	(74)	(260)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	13 000	(84)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	13 000	(84)	(265)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	14 200	(100)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	14 200	(100)	(272)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	13 700	(95)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	13 700	(95)	(257)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	14 200	(98)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	14 200	(98)	(261)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	17 400	(120)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	17 400	(120)	(361)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	14 900	(102)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	14 900	(102)	(325)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	10 800	(78)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	10 800	(78)	(209)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	25 900	(172)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	25 900	(172)	(538)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	38 900	(141)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	38 900	(141)	(506)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	24 600	(86)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	24 600	(86)	(341)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	22 800	(71)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	22 800	(71)	(285)	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)	(7)	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)	(116)	0,00
	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	(116)	(19)	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	(116)	(275)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	6 900	(16)	(13)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	6 900	(16)	(24)	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	123 600	(873)	(129)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,250	20/07/2023	3 000	(10)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	3 000	(10)	(12)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	9 500	(64)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	9 500	(64)	(200)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	6 900	(23)	(12)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	6 900	(23)	(28)	0,00
							\$ (9 995)	\$ (28 844)	(0,23)

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

Tableau des investissements Fonds Global 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
BOA	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000 %	20/06/2025	\$ 11 810	\$ (285)	\$ 429	\$ 144	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	17 350	(421)	633	212	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	4 020	(97)	146	49	0,00
					\$ (803)	\$ 1 208	\$ 405	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
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	\$ 526	\$ (309)	\$ 217	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	105 500	72 795	(26)	167	141	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)	168	(37)	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	(176)	111	0,00
						\$ 582	\$ (150)	\$ 432	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 %	15/03/2028	MYR 596 458	\$ (227)	\$ 1 113	\$ 886	0,01
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2033	227 400	(66)	579	513	0,01
BPS	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	197 614	(79)	373	294	0,00
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,545	05/05/2028	130 664	0	154	154	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,635	05/04/2024	265 697	(61)	41	(20)	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2033	56 073	117	9	126	0,00
GST	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	30 196	(11)	56	45	0,00
SCX	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	119 180	(359)	253	(106)	0,00
						\$ (686)	\$ 2 578	\$ 1 892	0,02

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	07/2023	AUD	1 137	\$ 744	\$ 0	\$ (13)	0,00
	07/2023	NZD	584	355	0	(3)	0,00
	07/2023	\$	5 026	AUD 7 574	16	16	0,00
	07/2023		344	NZD 559	0	(1)	0,00
	08/2023	AUD	7 574	\$ 5 030	0	(16)	0,00
BOA	07/2023		19 442	12 688	0	(253)	0,00
	07/2023	BRL	248	50	0	(1)	0,00
	07/2023	CAD	146 368	107 569	0	(3 043)	(0,02)
	07/2023	€	670 992	721 118	0	(10 935)	(0,09)
	07/2023	IDR	3 728 820	250	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		
	07/2023	KRW	899 153	\$ 700	\$ 17	\$ 0	\$ 17	0,00	
	07/2023	NOK	1 365		124	0	(4)	0,00	
	07/2023	NZD	22 612		13 719	0	(134)	0,00	
	07/2023	SEK	500		46	0	0	0,00	
	07/2023	\$	8 475	CAD	11 319	79	(1)	0,00	
	07/2023		141 207	DKK	960 098	0	(530)	0,00	
	07/2023		1 862	€	1 704	0	(3)	0,00	
	07/2023		28 630	£	22 634	146	0	0,00	
	07/2023		100	KRW	130 710	0	(1)	0,00	
	07/2023		16 091	MXN	296 227	1 138	0	1 138	0,01
	07/2023		63 791	NOK	701 238	1 662	0	1 662	0,01
	08/2023	DKK	958 495	\$	141 207	532	0	532	0,00
	08/2023	IDR	5 634 813		375	0	0	0	0,00
	08/2023	¥	15 293 337		110 915	4 226	0	4 226	0,03
	08/2023	KRW	65 888		50	0	0	0	0,00
	08/2023	TWD	449 705		14 781	339	0	339	0,00
	08/2023	\$	357	CNY	2 448	0	(18)	(18)	0,00
	09/2023	¥	46 240 000	\$	337 519	14 536	0	14 536	0,12
	09/2023	KRW	41 122 743		32 458	1 116	0	1 116	0,01
	09/2023	TWD	701 820		23 119	538	0	538	0,00
	09/2023	\$	12 765	IDR	191 086 376	0	(73)	(73)	0,00
	09/2023		26 402	INR	2 183 759	143	0	143	0,00
BPS	07/2023	AUD	20 419	\$	13 642	50	0	50	0,00
	07/2023	CAD	15 425		11 622	16	(51)	(35)	0,00
	07/2023	CHF	174		195	0	0	0	0,00
	07/2023	CZK	23 893		1 111	14	0	14	0,00
	07/2023	DKK	61 825		8 907	0	(152)	(152)	0,00
	07/2023	€	1 408 838		1 514 744	51	(22 351)	(22 300)	(0,18)
	07/2023	ILS	8 989		2 820	397	0	397	0,00
	07/2023	¥	14 201 368		102 216	3 961	0	3 961	0,03
	07/2023	MYR	30 459		6 636	98	0	98	0,00
	07/2023	NOK	165 409		15 383	0	(56)	(56)	0,00
	07/2023	NZD	21 503		13 233	64	(5)	59	0,00
	07/2023	\$	6 324	AUD	9 594	62	0	62	0,00
	07/2023		65	BRL	317	0	0	0	0,00
	07/2023		74 363	€	67 647	0	(560)	(560)	0,00
	07/2023		19 086	£	15 253	350	(45)	305	0,00
	07/2023		7 567	¥	1 051 813	0	(290)	(290)	0,00
	07/2023		414	NZD	688	8	0	8	0,00
	08/2023	AUD	5 415	\$	3 589	0	(18)	(18)	0,00
	08/2023	BRL	317		65	0	0	0	0,00
	08/2023	CNH	583 431		82 698	2 236	0	2 236	0,02
	08/2023	COP	20 000 000		4 360	0	(354)	(354)	0,00
	08/2023	TWD	351 285		11 506	225	0	225	0,00
	08/2023	\$	195	CHF	174	0	0	0	0,00
	08/2023		421	CNY	2 878	0	(23)	(23)	0,00
	08/2023		15 259	NOK	163 888	54	0	54	0,00
	09/2023	IDR	696 653	\$	46	0	0	0	0,00
	09/2023	THB	76		2	0	0	0	0,00
BRC	10/2023	ZAR	8 451		454	11	0	11	0,00
	07/2023	BRL	121		25	0	0	0	0,00
	07/2023	£	7 205		8 944	0	(216)	(216)	0,00
	07/2023	IDR	744 695		50	0	0	0	0,00
	07/2023	¥	51 240 000		396 159	40 954	0	40 954	0,33
	07/2023	NZD	709		426	0	(9)	(9)	0,00
	07/2023	\$	19 627	£	15 591	198	(3)	195	0,00
	07/2023		461	NZD	756	2	0	2	0,00
	09/2023	IDR	722 461	\$	48	0	0	0	0,00
	09/2023	ILS	27 435		7 670	256	0	256	0,00
	09/2023	\$	1 843	IDR	27 659 710	0	(6)	(6)	0,00
	09/2023		6 266	THB	218 569	0	(55)	(55)	0,00
	04/2024	¥	8 140 195	\$	66 630	7 785	0	7 785	0,06
CBK	05/2024		5 580 000		45 133	4 610	0	4 610	0,04
	07/2023	AUD	7 776		5 073	0	(103)	(103)	0,00
	07/2023	CZK	21 086		978	11	0	11	0,00
	07/2023	DKK	469 087		67 384	0	(1 348)	(1 348)	(0,01)
	07/2023	IDR	14 521 350		975	9	0	9	0,00
	07/2023	ILS	9 431		2 966	425	0	425	0,00
	07/2023	KRW	195 713		150	1	0	1	0,00
	07/2023	NOK	1 330		120	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	NZD	845		518	1	0	1	0,00
	07/2023	RON	1 376		304	2	0	2	0,00
	07/2023		1 129	AUD	1 688	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023		25	BRL	121	0	0	0	0,00
	07/2023		515	CAD	703	16	0	16	0,00
	07/2023		11 171	CLP	9 040 413	87	0	87	0,00
	07/2023		417 541	€	384 064	1 525	(51)	1 474	0,01
	07/2023		9 033	£	7 104	2	(4)	(2)	0,00
	07/2023		11 661	NOK	129 901	464	0	464	0,00
	08/2023	BRL	18 431	\$	3 566	0	(236)	(236)	0,00
	08/2023	€	350 430		381 526	0	(1 318)	(1 318)	(0,01)
	08/2023	¥	33 690 553		244 448	9 417	0	9 417	0,08

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
	08/2023	TWD		365 728	\$ 11 981	\$ 236	0,00
	08/2023	\$		1 378	CNH 9 610	0	0,00
	08/2023			677	ZAR 12 508	(53)	0,00
	09/2023	CNH		13 334	\$ 1 871	(18)	0,00
	09/2023	\$		312	KRW 401 547	27	0,00
	09/2023			3 485	THB 119 974	(6)	0,00
	10/2023	CLP		3 904 732	\$ 4 764	(76)	0,00
	10/2023	\$		8 206	CLP 6 703 029	(45)	0,00
	11/2023	ILS		101 207	\$ 30 243	49	0,00
CLY	07/2023	BRL		242	0	0	0,02
	07/2023	DKK		1 554 364	224 362	2 789	0,00
	07/2023	KRW		194 309	150	0	0,00
	07/2023	\$		546	SGD 723	(3 388)	0,00
	08/2023	CNH		53 735	\$ 7 579	(11)	0,00
FAR	07/2023	\$		17	CLP 13 870	0	0,00
GLM	07/2023	BRL		304 543	\$ 63 731	0	0,01
	07/2023	IDR		13 463 100	900	600	0,00
	07/2023	KRW		193 573	150	5	0,00
	07/2023	NOK		1 011 772	93 870	0	0,00
	07/2023	SGD		498	369	(569)	0,00
	07/2023	\$		56 406	BRL 303 740	1	0,00
	07/2023			50	KRW 66 248	6 558	0,05
	07/2023			251	MXN 4 415	0	0,00
	08/2023	CNH		201 680	\$ 28 707	6	0,00
	08/2023	\$		63 606	BRL 305 488	883	0,01
	08/2023			93 870	NOK 1 010 777	0	0,00
	08/2023			1 531	ZAR 28 414	(587)	0,01
	09/2023	CNH		192 043	\$ 26 956	572	0,00
	09/2023	\$		56 437	SGD 75 468	(33)	0,00
	09/2023			40 002	THB 1 378 061	394	0,00
JPM	10/2023	ZAR		2 164	\$ 115	0	0,00
	07/2023	AUD		17 304	11 313	(841)	0,00
	07/2023	KRW		173 842 951	136 116	2	0,00
	07/2023	MXN		2 641	153	(205)	0,03
	07/2023	SGD		21 675	16 406	0	0,00
	07/2023	\$		2 421	CAD 3 211	383	0,00
	07/2023			1 790 126	€ 1 639 578	6	0,00
	07/2023			666 422	£ 527 065	(1 470)	(0,01)
	07/2023			31 169	¥ 4 457 527	0	0,03
	07/2023			50	KRW 66 248	3 664	0,00
	07/2023			201	MXN 3 532	(329)	0,00
	07/2023			64 146	NZD 105 260	0	0,00
	07/2023			2 061	SGD 2 723	342	0,00
	08/2023	CNH		83 473	\$ 11 798	0	0,00
	08/2023	€		1 633 917	1 786 568	286	0,00
	08/2023	£		527 065	666 563	0	0,01
	08/2023	¥		18 014 696	129 593	(3 656)	(0,03)
	08/2023	NZD		105 260	64 140	0	0,00
	08/2023	\$		444	CNY 3 037	(339)	0,00
	08/2023			554	HUF 192 394	(24)	0,00
	08/2023			204	MXN 3 540	(1)	0,00
	09/2023	IDR		29 932	\$ 2	0	0,00
	09/2023	ILS		26 327	7 412	1	0,00
	09/2023	PEN		65 653	17 831	0	0,00
	09/2023	\$		5 313	IDR 79 933 034	(173)	0,00
	09/2023			10 257	INR 845 296	(3)	0,00
	09/2023			382	KRW 496 689	18	0,00
	09/2023			270	MXN 4 684	0	0,00
	09/2023			1 635	SGD 2 187	(3)	0,00
	09/2023			12 787	THB 438 491	(1)	0,00
	10/2023			158	ZAR 2 953	(15)	0,00
	12/2023			62 001	INR 5 116 400	(326)	0,00
MBC	10/2024	¥		7 740 000	\$ 62 332	0	0,00
	07/2023	CAD		97 861	73 004	4 924	0,04
	07/2023	€		14 493	15 571	0	0,00
	07/2023	£		36 632	46 841	(951)	(0,01)
	07/2023	¥		16 730 000	128 100	(241)	0,00
	07/2023	NOK		92 305	8 704	0	0,00
	07/2023	SGD		1 277	951	0	0,10
	07/2023	\$		24 097	AUD 36 110	88	0,00
	07/2023			130 082	CAD 174 416	7	0,00
	07/2023			10 269	€ 9 564	(61)	0,00
	07/2023			19 312	£ 15 497	(30)	0,01
	07/2023			5 695	¥ 818 600	(4)	0,00
	08/2023	CNH		291 997	\$ 41 895	0	0,00
	08/2023	¥		104 660 000	766 107	1 605	0,01
	08/2023	\$		249	ZAR 4 668	0	0,29
	09/2023	IDR		70 520	\$ 5	(3)	0,00
	09/2023	¥		4 870 000	35 475	0	0,00
	09/2023	KRW		75 933 081	59 541	1 426	0,01
	09/2023	\$		1 827	IDR 27 200 022	0	0,01
						(20)	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
	02/2024	¥	700 018	\$ 5 675	\$ 663	\$ 0	0,01
	03/2024		15 550 388	127 046	15 190	0	0,12
	10/2024		10 172 450	81 581	6 132	0	0,05
MYI	07/2023	€	2 228	2 426	0	(4)	0,00
	07/2023	£	562 571	699 204	0	(16 022)	(0,13)
	07/2023	IDR	68 027 969	4 543	10	0	0,00
	07/2023	KRW	905 289	700	12	0	0,00
	07/2023	NOK	624	58	0	(1)	0,00
	07/2023	NZD	1 996	1 208	0	(15)	0,00
	07/2023	SEK	25 249	2 352	15	0	0,00
	07/2023	\$	5 067	CAD 6 674	4	(27)	0,00
	07/2023		1 032	CHF 928	5	0	0,00
	07/2023		125 524	DKK 856 238	0	(65)	0,00
	07/2023		15 632	€ 14 338	11	0	0,00
	07/2023		4 705	£ 3 702	7	(6)	0,00
	07/2023		3 352	IDR 50 372 672	8	0	0,00
	07/2023		50	KRW 65 085	0	(1)	0,00
	07/2023		2 403	SEK 25 946	0	(1)	0,00
	08/2023	DKK	854 810	\$ 125 524	66	0	0,00
	08/2023	IDR	2 991 960	200	1	0	0,00
	08/2023	SEK	25 733	2 386	1	0	0,00
	08/2023	TWD	1 973 959	64 804	1 411	0	0,01
	08/2023	\$	618	ZAR 11 585	0	(7)	0,00
	09/2023	KRW	85 336 510	\$ 66 683	1 645	0	0,01
	09/2023	\$	18 251	IDR 272 682 426	0	(138)	0,00
	09/2023		2 214	INR 182 579	6	0	0,00
	09/2023		5 838	THB 199 874	0	(158)	0,00
	10/2023		417	ZAR 7 798	0	(9)	0,00
RBC	07/2023	CAD	66	\$ 50	0	0	0,00
	07/2023	KRW	65 282	50	0	0	0,00
	07/2023	MXN	483 259	25 116	0	(3 013)	(0,02)
	07/2023	\$	1 536	AUD 2 369	41	0	0,00
	07/2023		452	CAD 616	14	0	0,00
	08/2023		24 406	MXN 422 963	57	0	0,00
RYL	07/2023	NZD	715	\$ 442	3	0	0,00
	07/2023	\$	368	NZD 592	0	(5)	0,00
SCX	07/2023	AUD	24 427	\$ 15 961	0	(298)	0,00
	07/2023	CHF	425	468	0	(7)	0,00
	07/2023	MYR	30 458	6 627	89	0	0,00
	07/2023	NOK	2 700	245	0	(7)	0,00
	07/2023	NZD	58 891	35 756	0	(324)	0,00
	07/2023	\$	7 385	AUD 11 125	20	0	0,00
	07/2023		25	BRL 123	0	0	0,00
	07/2023		4 970	CAD 6 750	131	0	0,00
	07/2023		408	CHF 367	2	0	0,00
	08/2023	AUD	11 125	\$ 7 391	0	(20)	0,00
	08/2023	CNH	9 683	1 406	71	0	0,00
	08/2023	TWD	1 258 228	41 205	798	0	0,01
	08/2023	\$	1 181	CNY 8 063	0	(66)	0,00
	09/2023	CNH	108 227	\$ 15 167	198	0	0,00
	09/2023	IDR	30 357 959	2 041	25	0	0,00
	09/2023	TWD	589 168	19 325	369	0	0,00
	09/2023	\$	18 033	IDR 270 631 595	0	(57)	0,00
	09/2023		6 419	INR 528 663	7	0	0,00
	09/2023		25 919	KRW 33 016 087	0	(756)	(0,01)
	09/2023		13 561	THB 468 253	0	(254)	0,00
SOG	07/2023	AUD	7 510	\$ 4 913	0	(86)	0,00
	07/2023	BRL	120	25	0	0	0,00
	07/2023	SGD	5	4	0	0	0,00
	07/2023	\$	175	BRL 854	2	0	0,00
	07/2023		772	PLN 3 326	46	0	0,00
SSB	07/2023	CLP	18 405 696	\$ 22 722	0	(170)	0,00
	08/2023	¥	27 020 000	203 550	15 467	0	0,12
	08/2023	\$	7 196	CLP 5 797 132	0	(1)	0,00
	09/2023	KRW	81 008 828	\$ 62 458	718	0	0,01
	09/2023	\$	7 147	BRL 36 231	281	0	0,00
TOR	07/2023	AUD	3 974	\$ 2 599	0	(46)	0,00
	07/2023	\$	9 043	AUD 13 691	71	0	0,00
	07/2023		44 725	CAD 59 180	31	(33)	0,00
	07/2023		54 686	¥ 7 872 885	0	(215)	0,00
	08/2023	AUD	13 691	\$ 9 051	0	(70)	0,00
	08/2023	CAD	59 157	44 725	33	(31)	0,00
	08/2023	¥	7 779 552	54 255	203	0	0,00
	08/2023	\$	214	HUF 74 978	3	0	0,00
	09/2023	¥	36 380 000	\$ 258 195	3 269	0	0,03
UAG	07/2023	AUD	910	596	0	(10)	0,00
	07/2023	CHF	687	764	0	(4)	0,00
	07/2023	¥	28 330 000	216 110	19 958	0	0,16
	07/2023	\$	14 570	AUD 21 821	30	(76)	0,00
	07/2023		247	MXN 4 396	9	0	0,00
	07/2023		44 328	NOK 490 507	1 456	0	0,01
	08/2023	AUD	21 821	\$ 14 582	75	(30)	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
	08/2023	\$ 3 764	CNH 26 091	\$ 0	\$ (166)	\$ (166)	0,00
	08/2023	1 021	ZAR 18 689	0	(35)	(35)	0,00
	09/2023	CNH 81 161	THB 393 063	0	(56)	(56)	0,00
	09/2023	ILS 22 785	\$ 6 364	207	0	207	0,00
	09/2023	SGD 57 024	42 667	411	0	411	0,00
	09/2023	\$ 24 989	INR 2 065 904	122	0	122	0,00
				\$ 255 439	\$ (78 681)	\$ 176 758	1,40

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 13 013	CAD 17 706	\$ 368	\$ 0	\$ 368	0,00
CBK	07/2023	13 085	17 830	390	0	390	0,01
JPM	07/2023	13 035	17 683	329	0	329	0,00
MBC	07/2023	CAD 605	\$ 447	0	(11)	(11)	0,00
	07/2023	\$ 300	CAD 402	4	0	4	0,00
UAG	07/2023	623	850	19	0	19	0,00
				\$ 1 110	\$ (11)	\$ 1 099	0,01

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	CHF 21	\$ 23	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 383	CHF 343	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	CHF 229 405	\$ 256 504	86	0	86	0,00
	07/2023	\$ 259 072	CHF 234 190	2 695	0	2 695	0,02
	08/2023	256 479	228 730	0	(87)	(87)	0,00
CLY	07/2023	CHF 121 237	\$ 134 969	0	(544)	(544)	(0,01)
	08/2023	\$ 134 969	CHF 120 893	544	0	544	0,00
GLM	07/2023	49 977	45 312	671	0	671	0,01
JPM	07/2023	CHF 101	\$ 111	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07/2023	421	467	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	\$ 300	CHF 269	1	0	1	0,00
MYI	07/2023	CHF 3 050	\$ 3 370	0	(40)	(40)	0,00
	07/2023	\$ 103	CHF 94	1	0	1	0,00
RBC	07/2023	CHF 333	\$ 372	1	0	1	0,00
RYL	07/2023	122	136	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2023	4	5	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 278 966	CHF 250 916	1 497	0	1 497	0,01
UAG	07/2023	CHF 237 120	\$ 264 520	0	(522)	(522)	0,00
	07/2023	\$ 221 765	CHF 199 266	965	0	965	0,01
	08/2023	264 477	236 407	521	0	521	0,00
				\$ 6 982	\$ (1 199)	\$ 5 783	0,04

Au 30 juin 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	07/2023	AUD 2 175	\$ 1 443	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07/2023	\$ 270	AUD 412	5	0	5	0,00
	08/2023	1 444	2 175	4	0	4	0,00
BOA	07/2023	CLP 241 528	\$ 299	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	DKK 5 589	822	3	0	3	0,00
	07/2023	€ 391	425	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	PEN 1 112	306	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	SEK 28 622	2 652	2	0	2	0,00
	07/2023	THB 72 441	2 036	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	\$ 2 168	AUD 3 320	42	0	42	0,00
	07/2023	23 997	CAD 32 608	645	0	645	0,01
	07/2023	298	CLP 241 516	3	0	3	0,00
	07/2023	22 666	CNY 160 804	0	(508)	(508)	(0,01)
	07/2023	662	COP 2 967 058	49	0	49	0,00
	07/2023	445	DKK 3 079	6	0	6	0,00
	07/2023	465	HUF 162 249	10	0	10	0,00
	07/2023	2 222	¥ 311 031	0	(70)	(70)	0,00
	07/2023	2 976	KRW 3 941 530	16	0	16	0,00
	07/2023	301	NOK 3 313	8	0	8	0,00
	07/2023	373	NZD 615	4	0	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		
	07/2023	\$	301	PEN	1 112	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
	07/2023		52	SEK	559	0	0	0	0,00
	08/2023		298	CLP	241 528	2	0	2	0,00
	08/2023		4 019	CNY	29 033	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023		822	DKK	5 579	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023		305	PEN	1 112	1	0	1	0,00
	08/2023		2 652	SEK	28 587	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023		2 041	THB	72 441	8	0	8	0,00
BPS	07/2023	AUD	1 788	\$	1 182	0	(8)	(8)	0,00
	07/2023	CHF	3 709		4 147	1	0	1	0,00
	07/2023	CNY	164 618		22 787	104	0	104	0,00
	07/2023	€	156 406		171 375	736	0	736	0,01
	07/2023	£	1 073		1 327	0	(37)	(37)	0,00
	07/2023	NOK	809		75	0	0	0	0,00
	07/2023	TWD	3 965		129	2	0	2	0,00
	07/2023	\$	617	CNY	4 383	0	(13)	(13)	0,00
	07/2023		1 180	CZK	25 996	14	0	14	0,00
	07/2023		2	DKK	11	0	0	0	0,00
	07/2023		1 402	€	1 284	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023		105	£	82	0	(1)	(1)	0,00
								(3 440)	
	07/2023		89 810	¥	12 483 426	0	(3 440)		(0,03)
	07/2023		33	NZD	55	1	0	1	0,00
	08/2023		1 031	AUD	1 555	5	0	5	0,00
	08/2023		4 147	CHF	3 698	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023		22 787	CNY	164 385	0	(60)	(60)	0,00
	08/2023		171 226	€	156 052	0	(740)	(740)	(0,01)
	08/2023		75	NOK	808	0	0	0	0,00
BRC	07/2023	KRW	3 940 645	\$	2 986	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	\$	2 976	KRW	3 937 810	13	0	13	0,00
	07/2023		1 431	PLN	6 043	56	0	56	0,00
	08/2023		2 986	KRW	3 935 689	5	0	5	0,00
CBK	07/2023	CAD	1 285	\$	943	0	(28)	(28)	0,00
	07/2023	€	325		350	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	ILS	3 410		940	21	0	21	0,00
	07/2023	MXN	42 784		2 489	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	\$	935	AUD	1 433	19	0	19	0,00
	07/2023		2 233	CNY	15 851	0	(49)	(49)	0,00
	07/2023		193	€	178	1	0	1	0,00
	07/2023		2 378	MXN	42 784	116	0	116	0,00
	07/2023		27	NOK	295	1	0	1	0,00
	07/2023		128	TWD	3 977	0	0	0	0,00
	08/2023	TWD	3 978	\$	128	0	0	0	0,00
	08/2023	\$	940	ILS	3 407	0	(21)	(21)	0,00
	08/2023		2 476	MXN	42 784	5	0	5	0,00
CLY	07/2023	CHF	94	\$	104	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	1 306	DKK	9 048	20	0	20	0,00
	08/2023		104	CHF	93	0	0	0	0,00
GLM	07/2023	COP	2 967 058	\$	715	5	0	5	0,00
	07/2023	NOK	4 987		463	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$	2 820	MYR	12 650	0	(110)	(110)	0,00
	07/2023		2 097	THB	72 441	0	(54)	(54)	0,00
	08/2023		708	COP	2 967 058	0	(4)	(4)	0,00
	08/2023		463	NOK	4 982	3	0	3	0,00
JPM	07/2023	€	7 028	\$	7 514	0	(153)	(153)	0,00
	07/2023	¥	4 357 101		30 467	321	0	321	0,00
	07/2023	SGD	99		73	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	2 085	AUD	3 189	38	0	38	0,00
	08/2023		30 467	¥	4 338 586	0	(323)	(323)	0,00
	08/2023		526	KRW	694 391	2	0	2	0,00
	08/2023		73	SGD	99	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	CAD	1 184	\$	874	0	(21)	(21)	0,00
	07/2023	€	1 455		1 559	0	(29)	(29)	0,00
	07/2023	\$	22 251	CNY	157 934	0	(489)	(489)	0,00
	07/2023		894	€	835	17	0	17	0,00
	07/2023		31 582	£	25 513	854	0	854	0,01
	07/2023		1 416	SGD	1 913	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07/2023	CZK	26 030	\$	1 200	5	0	5	0,00
	07/2023	DKK	4 984		731	0	0	0	0,00
	07/2023	IDR	56 374 989		3 741	0	(17)	(17)	0,00
	07/2023	MYR	12 650		2 727	16	0	16	0,00
	07/2023	PLN	6 046		1 493	4	0	4	0,00
	07/2023	SGD	1 981		1 466	2	0	2	0,00
	07/2023	\$	52	CHF	47	1	0	1	0,00
	07/2023		0	CLP	12	0	0	0	0,00
	07/2023		914	ILS	3 403	3	0	3	0,00
	07/2023		2 611	SEK	28 031	0	(16)	(16)	0,00
	08/2023		1 200	CZK	26 062	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023		731	DKK	4 976	0	0	0	0,00
	08/2023		3 741	IDR	56 396 310	8	0	8	0,00
	08/2023		2 730	MYR	12 650	0	(14)	(14)	0,00
	08/2023		1 493	PLN	6 055	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023		1 466	SGD	1 979	0	(2)	(2)	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	
SCX	07/2023	AUD	\$ 3 194	\$ 2 120	\$ 0	\$ (6)	0,00	
	07/2023	IDR	79 551	5	0	0	0,00	
	07/2023	\$	2 941	AUD 4 501	55	0	55	0,00
	07/2023		4 022	CHF 3 614	17	0	17	0,00
	07/2023		972	NZD 1 601	9	0	9	0,00
SOG	08/2023		2 122	AUD 3 194	6	0	6	0,00
	07/2023		1 783	2 725	31	0	31	0,00
TOR	07/2023		175 713	€ 163 342	2 493	0	2 493	0,02
	07/2023	AUD	3 931	\$ 2 596	0	(20)	(20)	0,00
	07/2023	CAD	20 177	15 203	0	(45)	(45)	0,00
	07/2023	£	24 522	31 160	0	(16)	(16)	0,00
	07/2023	HUF	162 573	481	6	0	6	0,00
	07/2023	NZD	2 271	1 383	0	(8)	(8)	0,00
	07/2023	\$	943	AUD 1 442	17	0	17	0,00
	08/2023		2 599	3 931	20	0	20	0,00
	08/2023		15 203	CAD 20 169	45	0	45	0,00
	08/2023		31 167	£ 24 522	15	0	15	0,00
	08/2023		481	HUF 163 800	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023		1 383	NZD 2 271	8	0	8	0,00
	UAG	07/2023	AUD	6 265	\$ 4 183	22	(9)	13
07/2023		CHF	91	102	0	0	0	0,00
07/2023		\$	216	AUD 330	4	0	4	0,00
07/2023			262	CHF 235	1	0	1	0,00
07/2023			22 223	CNY 156 221	0	(697)	(697)	(0,01)
07/2023			2	CZK 36	0	0	0	0,00
07/2023			3 741	IDR 56 160 911	1	0	1	0,00
07/2023			2 974	KRW 3 921 725	3	0	3	0,00
07/2023			219	NOK 2 418	7	0	7	0,00
07/2023			125	SGD 169	0	0	0	0,00
08/2023			4 187	AUD 6 265	9	(22)	(13)	0,00
08/2023			102	CHF 91	0	0	0	0,00
					\$ 5 982	\$ (7 095)	\$ (1 113)	(0,01)

Au 30 juin 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	
BOA	07/2023	€	4 836	\$ 5 285	9	0	0,00	
	07/2023	\$	1 298 096	€ 1 207 861	19 682	0	19 682	0,16
BPS	07/2023	€	1 220 730	\$ 1 337 499	5 684	(1)	5 683	0,04
	07/2023	\$	1 299 719	€ 1 208 995	19 304	(8)	19 296	0,15
CBK	08/2023		1 323 551	1 206 256	0	(5 725)	(5 725)	(0,05)
	07/2023	€	1 238 349	\$ 1 346 016	20	(5 044)	(5 024)	(0,04)
	07/2023	\$	4 690	€ 4 347	52	0	52	0,00
JPM	08/2023		1 308 845	1 202 172	4 520	0	4 520	0,04
	07/2023	€	1 202 172	\$ 1 312 651	1 081	0	1 081	0,01
	07/2023	\$	47 005	€ 43 964	960	0	960	0,01
MBC	08/2023		1 314 487	1 202 172	0	(1 122)	(1 122)	(0,01)
	07/2023	€	27 560	\$ 29 628	0	(439)	(439)	0,00
SOG	07/2023	\$	8 473	€ 7 898	147	(3)	144	0,00
	07/2023		1 298 346	1 206 934	18 420	0	18 420	0,15
				\$ 69 879	\$ (12 342)	\$ 57 537	0,46	

Au 30 juin 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	07/2023	£	43	\$ 54	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$	6 162	£ 4 872	32	0	32	0,00
BPS	07/2023	£	30	\$ 37	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$	126 704	£ 102 436	3 528	0	3 528	0,03
BRC	07/2023	£	14	\$ 17	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	3 763	£ 3 025	83	0	83	0,00
CBK	07/2023	£	9 279	\$ 11 709	8	(96)	(88)	0,00
	07/2023		101 323	128 113	0	(704)	(704)	(0,01)
JPM	08/2023	\$	128 140	£ 101 323	703	0	703	0,01
	07/2023		127 079	102 651	3 426	0	3 426	0,03
MBC	07/2023		126 187	101 529	2 892	0	2 892	0,02
TOR	07/2023	£	102 058	\$ 129 685	0	(66)	(66)	0,00
	08/2023	\$	129 713	£ 102 058	64	0	64	0,00
				\$ 10 736	\$ (868)	\$ 9 868	0,08	

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 105 240	NOK 1 161 036	\$ 3 132	\$ (1)	\$ 3 131	0,02
BPS	07/2023	NOK 747 566	\$ 69 286	0	(492)	(492)	0,00
	08/2023	\$ 57 195	NOK 614 290	201	0	201	0,00
CBK	07/2023	NOK 189 152	\$ 17 148	0	(507)	(507)	0,00
	07/2023	\$ 90 205	NOK 1 014 373	4 476	0	4 476	0,03
GLM	07/2023	NOK 650 360	\$ 60 339	0	(366)	(366)	0,00
	07/2023	\$ 185	NOK 1 985	0	0	0	0,00
	08/2023	60 339	649 721	367	0	367	0,00
MBC	07/2023	NOK 133 216	\$ 12 078	1	(357)	(356)	0,00
	07/2023	\$ 8	NOK 87	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	NOK 2 574	\$ 241	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 9	NOK 102	0	0	0	0,00
RYL	07/2023	655	7 059	4	0	4	0,00
SCX	07/2023	NOK 132 468	\$ 12 086	0	(279)	(279)	0,00
	07/2023	\$ 32	NOK 340	0	0	0	0,00
TOR	07/2023	NOK 132 532	\$ 11 970	0	(400)	(400)	0,00
UAG	07/2023	\$ 80 572	NOK 891 567	2 647	0	2 647	0,02
				\$ 10 829	\$ (2 402)	\$ 8 427	0,07

Au 30 juin 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
AZD	07/2023	NZD 3	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	07/2023	\$ 31 766	NZD 52 358	311	0	311	0,00
BPS	07/2023	NZD 2 898	\$ 1 757	0	(19)	(19)	0,00
	07/2023	\$ 1 214	NZD 1 971	0	(6)	(6)	0,00
BRC	07/2023	NZD 57 640	\$ 35 051	0	(262)	(262)	0,00
	07/2023	\$ 23 373	NZD 38 932	479	0	479	0,01
	08/2023	35 047	57 640	262	0	262	0,00
CBK	07/2023	NZD 73	\$ 45	0	0	0	0,00
DUB	07/2023	\$ 10	NZD 16	0	0	0	0,00
JPM	07/2023	NZD 56 492	\$ 34 428	1	(183)	(182)	0,00
	08/2023	\$ 34 307	NZD 56 301	181	0	181	0,00
MYI	07/2023	25 562	42 236	314	0	314	0,00
RYL	07/2023	NZD 175	\$ 108	1	0	1	0,00
SCX	07/2023	\$ 24 427	NZD 40 231	221	0	221	0,00
TOR	07/2023	NZD 58 593	\$ 35 683	0	(214)	(214)	0,00
	08/2023	\$ 35 600	NZD 58 463	213	0	213	0,00
				\$ 1 983	\$ (684)	\$ 1 299	0,01

Au 30 juin 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	07/2023	SEK 450 347	\$ 41 727	\$ 37	\$ (3)	\$ 34	0,00
	07/2023	\$ 138	SEK 1 485	1	(1)	0	0,00
	08/2023	40 079	431 992	0	(34)	(34)	0,00
BRC	07/2023	SEK 242	\$ 23	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	\$ 27 855	SEK 304 232	312	0	312	0,00
GLM	07/2023	87	931	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07/2023	SEK 19	\$ 2	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 26 972	SEK 290 473	0	(79)	(79)	0,00
MYI	07/2023	SEK 432 715	\$ 40 079	17	0	17	0,00
	07/2023	\$ 39 326	SEK 422 165	0	(241)	(241)	0,00
	08/2023	40 079	432 178	0	(17)	(17)	0,00
SCX	07/2023	SEK 480	\$ 45	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 27 090	SEK 293 027	39	0	39	0,00
				\$ 406	\$ (376)	\$ 30	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

Au 30 juin 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
BRC	07/2023	\$ 65 357	SGD 88 436	\$ 0	\$ (11)	\$ (11)	0,00
GLM	07/2023	SGD 3 029	\$ 2 255	17	0	17	0,00
	07/2023	\$ 2 524	SGD 3 398	0	(13)	(13)	0,00
JPM	07/2023	SGD 87 984	\$ 65 019	7	0	7	0,00
	07/2023	\$ 6 906	SGD 9 346	0	0	0	0,00
	08/2023	65 019	87 899	0	(5)	(5)	0,00
MBC	07/2023	62 279	84 154	1	(97)	(96)	0,00
	08/2023	118	159	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	SGD 84 903	\$ 62 835	100	0	100	0,00
	08/2023	\$ 62 762	SGD 84 727	0	(95)	(95)	0,00
UAG	07/2023	SGD 256	\$ 191	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 63 197	SGD 85 489	0	(28)	(28)	0,00
				\$ 126	\$ (249)	\$ (123)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 249 723 1,98

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 4,000 % éch. 01/08/2053	\$ 7 500	\$ (7 103)	(0,06)
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 2,000 % éch. 01/07/2038	199 400	(176 718)	(1,40)
2,000 % éch. 01/07/2053	107 526	(87 714)	(0,69)
2,000 % éch. 01/08/2053	551 624	(450 629)	(3,57)
3,000 % éch. 01/08/2053	900	(793)	(0,01)
Total des Titres vendus à découvert	\$	(722 957)	(5,73)
Total des Investissements	\$	15 950 017	126,47
Autres actifs et passifs à court terme	\$	(3 338 307)	(26,47)
Actifs nets	\$	12 611 710	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) Titre convertible conditionnel.

(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	\$ 31 674	0,25
Deutsche Bank AG	3,729	14/01/2032	21/01/2021	2 005	1 514	0,01
				\$ 35 105	\$ 33 188	0,26

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 956 \$ (31 décembre 2022 : 1 610 \$) 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 352 461 \$ (31 décembre 2022 : 312 124 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 13 960 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 14 570 392	\$ 38 548	\$ 14 608 940
Fonds d'investissement	1 249 595	0	0	1 249 595
Contrats de mise en pension	0	721 100	0	721 100
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	20 386	72 953	0	93 339
Titres vendus à découvert	0	(722 957)	0	(722 957)
Totaux	\$ 1 269 981	\$ 14 641 488	\$ 38 548	\$ 15 950 017

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 30 juin 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
MBC	2,800 %	03/07/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (940)	\$ (1 025)	(0,01)
	3,750	30/06/2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (870)	(870)	(0,01)
Total des Contrats de prise en pension					\$ (1 895)	(0,02)

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 205	\$ 330	\$ 535	\$ (1 118)	\$ 1 920	\$ 802
BOA	28 610	(25 370)	3 240	(61 601)	51 870	(9 731)
BPS	6 617	(4 950)	1 667	2 102	(1 850)	252
BRC	54 200	(52 340)	1 860	1 917	(1 260)	657
CBK	15 509	(15 390)	119	57 544	(56 500)	1 044
CLY	(3 209)	0	(3 209)	(438)	0	(438)
DUB	(1 154)	560	(594)	(789)	220	(569)
FAR	(622)	400	(222)	(224)	0	(224)
FBF	S/O	S/O	S/O	40	0	40
GLM	2 854	(2 150)	704	(7 627)	6 700	(927)
GST	45	(40)	5	(287)	280	(7)
HUS	S/O	S/O	S/O	(120)	140	20
IND	0	3 050	3 050	2 835	(2 760)	75
JPM	14 077	(14 700)	(623)	3 194	(3 600)	(406)
MBC	79 744	(77 560)	2 184	(13 437)	11 460	(1 977)
MYC	(131)	270	139	(35)	350	315
MYI	(10 340)	6 480	(3 860)	(9 902)	7 130	(2 772)
RBC	(2 900)	2 870	(30)	(363)	320	(43)
RYL	2	0	2	2	0	2
SCX	1 374	(420)	954	(36 806)	34 940	(1 866)
SOG	20 906	(15 440)	5 466	394	(300)	94
SSB	16 295	(16 720)	(425)	2 274	(1 930)	344
TOR	2 828	(2 820)	8	(12 186)	12 810	624
UAG	24 813	(22 820)	1 993	(15 867)	14 840	(1 027)

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance.

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	66,31	67,82
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	49,52	30,98
Autres valeurs mobilières	S/O	0,69
Fonds d'investissement	9,91	9,82
Contrats de mise en pension	5,72	11,79
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,18	0,62
Instruments financiers dérivés compensés	(1,42)	(2,82)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,98	(0,79)
Titres vendus à découvert	(5,73)	(6,32)
Contrats de prise en pension	(0,02)	(0,01)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	1,33	1,53
Autriche	S/O	0,07
Brésil	S/O	0,00
Canada	0,50	0,68
Îles Caïmans	2,05	2,31
Chine	0,07	0,01
République tchèque	0,00	0,00
Danemark	2,38	2,36
Finlande	0,01	0,01
France	2,10	2,98
Allemagne	1,91	2,15
Hong Kong	0,17	0,25
Hongrie	0,18	0,04
Internationales	0,22	S/O
Irlande	5,24	5,70
Israël	0,48	0,46
Italie	1,07	1,23
Japon	7,95	6,06
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,07	0,08
Luxembourg	0,56	0,55
Malaisie	0,27	0,60
Mexique	0,06	0,12
Multinationales	0,09	0,10
Pays-Bas	0,63	1,10
Nouvelle-Zélande	0,14	0,21
Norvège	0,20	0,27
Pérou	0,15	0,52
Pologne	0,28	0,03
Portugal	0,02	0,01
Qatar	0,12	0,13
Roumanie	0,64	0,51
Arabie saoudite	0,69	0,14
Serbie	S/O	0,22
Singapour	0,08	S/O
Slovénie	0,18	0,19
Afrique du Sud	S/O	0,00
Corée du Sud	2,46	0,98
Espagne	0,72	0,96
Supranationales	0,18	0,20
Suède	0,00	0,00
Suisse	1,30	1,25
Thaïlande	S/O	0,29
Émirats arabes unis	0,06	0,07
Royaume-Uni	6,00	8,24
États-Unis	53,63	39,76
Instruments à court terme	21,64	17,12
Fonds d'investissement	9,91	9,82
Contrats de mise en pension	5,72	11,79
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,19	0,63
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	(0,01)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,01)	(0,03)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,07)	(0,13)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,07	S/O
Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base	S/O	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(1,41)	(2,67)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,04	0,05
Options sur titres	0,09	0,09
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,23)	(0,28)

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
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 sur devises croisées	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,02	(0,01)
Contrats de change à terme	1,40	(1,70)
Contrats de change à terme couverts	0,66	1,07
Titres vendus à découvert	(5,73)	(6,32)
Autres actifs et passifs à court terme	(26,47)	(11,79)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN %DE VALEUR L'ACTIF (en milliers)	%DE L'ACTIF NET
T-Mobile USA, Inc. 5,050 % éch. 15/07/2033	\$ 7 600	\$ 7 466	0,22
ZF North America Capital, Inc. 6,875 % éch. 14/04/2028	2 700	2 737	0,08
7,125 % éch. 14/04/2030	3 400	3 462	0,10
		48 771	1,46

SERVICES AUX COLLECTIVITÉS

AES Corp. 5,450 % éch. 01/06/2028	11 700	11 499	0,34
Électricité de France S.A. 6,250 % éch. 23/05/2033	4 000	4 069	0,12
6,900 % éch. 23/05/2053	3 000	3 112	0,09
National Grid PLC 5,809 % éch. 12/06/2033	3 800	3 869	0,12
Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % éch. 01/04/2053	8 000	7 862	0,24
Southern Power Co. 0,900 % éch. 15/01/2026	6 000	5 380	0,16
Verizon Communications, Inc. 5,050 % éch. 09/05/2033	5 400	5 343	0,16
		41 134	1,23
Total des Obligations et billets privés		651 045	19,46

Obligations California State General Obligation Bonds, Series 2023 5,125 % éch. 01/03/2038	3 600	3 623	0,11
---	-------	-------	------

AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN

Fannie Mae 3,000 % éch. 01/03/2060	1 090	964	0,03
3,500 % éch. 01/01/2059	640	584	0,02
Freddie Mac 3,500 % éch. 01/05/2048	5 320	4 919	0,15
4,000 % éch. 01/06/2048	3 877	3 714	0,11
Ginnie Mae 3,000 % éch. 20/07/2046 - 20/05/2047	23	21	0,00
6,464 % éch. 20/04/2067	199	198	0,01
Titre adossé à des créances hypothécaires uniformes (UMBS)			
2,500 % éch. 01/12/2051 - 01/03/2052	47 565	40 419	1,21
3,000 % éch. 01/07/2052	8 161	7 196	0,22
3,500 % éch. 01/03/2047 - 01/04/2053	29 260	26 733	0,80
4,000 % éch. 01/07/2048 - 01/07/2053	129 473	121 637	3,64
4,500 % éch. 01/12/2052 - 01/06/2053	44 738	43 039	1,29
5,000 % éch. 01/02/2053	138 219	135 521	4,05
5,500 % éch. 01/02/2053	85 073	84 715	2,53
6,000 % éch. 01/01/2053	41 263	41 644	1,24
6,500 % éch. 01/01/2053	22 200	22 682	0,68
Titre adossé à des créances hypothécaires uniformes (UMBS), TBA			
2,500 % éch. 01/08/2053	13 000	11 042	0,33
4,500 % éch. 01/08/2053	111 400	107 162	3,20
5,500 % éch. 01/08/2053	100 000	99 508	2,97
6,000 % éch. 01/07/2053	192 600	194 270	5,81
6,500 % éch. 01/07/2053	214 400	218 923	6,53
		1 164 891	34,82

OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN

Obligations du Trésor américain 1,625 % éch. 15/11/2050	10 100	6 278	0,19
1,875 % éch. 15/02/2041	42 500	30 897	0,92
2,875 % éch. 15/05/2052	6 900	5 721	0,17
4,000 % éch. 15/11/2052	5 200	5 343	0,16
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c)			
0,125 % éch. 15/04/2025	24 777	23 573	0,71
0,125 % éch. 15/07/2031	16 636	14 759	0,44
0,125 % éch. 15/01/2032	27 683	24 384	0,73
0,250 % éch. 15/01/2025	27 020	25 906	0,78
0,500 % éch. 15/01/2028	10 452	9 780	0,29
0,625 % éch. 15/07/2032	1 566	1 440	0,04
1,125 % éch. 15/01/2033	34 722	33 289	1,00
2,500 % éch. 15/01/2029	4 168	4 293	0,13
3,875 % éch. 15/04/2029	738	816	0,02

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF (en milliers)	% DE L'ACTIF NET
Billets du Trésor américain 0,375 % éch. 30/09/2027	\$ 2 900	\$ 2 469	0,07
0,625 % éch. 30/11/2027	12 800	10 965	0,33
0,750 % éch. 31/01/2028	11 700	10 039	0,30
2,875 % éch. 30/04/2025	4 200	4 045	0,12
		213 997	6,40

TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

American Home Mortgage Assets Trust 4,916 % éch. 25/10/2046	81	57	0,00
5,340 % éch. 25/10/2046	1 050	579	0,02
American Home Mortgage Investment Trust 7,129 % éch. 25/09/2035	170	76	0,00
Atlas Funding PLC 5,432 % éch. 25/07/2058	£ 1 712	2 176	0,07
Atrium Hotel Portfolio Trust 6,373 % éch. 15/12/2036	\$ 5 000	4 829	0,14
Avon Finance PLC 5,809 % éch. 20/09/2048	£ 1 377	1 751	0,05
Bear Stearns ALT-A Trust 3,817 % éch. 25/11/2036 ^	\$ 612	323	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust 5,320 % éch. 25/06/2047	947	799	0,02
Brass PLC 5,430 % éch. 16/11/2066	£ 364	464	0,01
Canada Square Funding PLC 5,682 % éch. 17/06/2058	1 868	2 362	0,07
5,852 % éch. 17/06/2058	3 176	4 019	0,12
6,152 % éch. 17/12/2057	1 386	1 766	0,05
Charter Mortgage Funding PLC 5,327 % éch. 16/01/2057	520	660	0,02
Chase Mortgage Finance Trust 4,529 % éch. 25/07/2037	\$ 7	5	0,00
Citigroup Commercial Mortgage Trust 3,209 % éch. 10/05/2049	2 100	1 948	0,06
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 3,994 % éch. 25/12/2035 ^	343	225	0,01
Commercial Mortgage Trust 3,590 % éch. 10/11/2047	2 000	1 924	0,06
3,732 % éch. 10/08/2049	1 000	940	0,03
4,228 % éch. 10/05/2051	1 700	1 589	0,05
Countrywide Alternative Loan Trust 5,390 % éch. 25/06/2036	73	66	0,00
5,500 % éch. 25/11/2034	120	116	0,00
5,570 % éch. 25/07/2046 ^	448	372	0,01
5,630 % éch. 25/08/2047	866	724	0,02
6,250 % éch. 25/12/2036	1 036	472	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 5,690 % éch. 25/04/2046	1 851	539	0,02
5,730 % éch. 25/03/2035 ^	341	280	0,01
5,830 % éch. 25/03/2035 ^	69	61	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036	248	135	0,00
6,000 % éch. 25/12/2036 ^	602	261	0,01
6,000 % éch. 25/03/2037	598	302	0,01
6,500 % éch. 25/11/2047	92	50	0,00
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust 5,450 % éch. 25/09/2047 ^	724	616	0,02
5,710 % éch. 25/08/2036	4 046	3 649	0,11
Dutch Property Finance BV 3,892 % éch. 28/07/2058	€ 2 249	2 450	0,07
EMF-UK PLC 5,970 % éch. 13/03/2046	£ 204	257	0,01
Eurohome UK Mortgages PLC 5,137 % éch. 15/06/2044	22	27	0,00
EuroMASTR PLC 5,205 % éch. 15/06/2040	45	53	0,00
Eurosail PLC 3,629 % éch. 13/03/2045	€ 29	31	0,00
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust 6,250 % éch. 25/11/2036 ^	\$ 33	11	0,00
Genesis Mortgage Funding PLC 6,081 % éch. 15/09/2059	£ 8 124	10 347	0,31
GSR Mortgage Loan Trust 4,481 % éch. 25/11/2035	\$ 47	47	0,00
5,024 % éch. 25/10/2035 ^	22	20	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF (en milliers)	% DE L'ACTIF NET
Impac Secured Assets Trust 5,670 % éch. 25/01/2037	\$ 463	\$ 371	0,01
IndyMac Mortgage Loan Trust 3,916 % éch. 25/12/2034	118	112	0,00
5,490 % éch. 25/11/2036	2 443	2 371	0,07
JPMorgan Alternative Loan Trust 5,630 % éch. 25/10/2036	228	204	0,01
JPMorgan Mortgage Trust 4,179 % éch. 25/08/2035	99	95	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037	768	345	0,01
Lehman XS Trust 5,476 % éch. 25/03/2047	436	411	0,01
Ludgate Funding PLC 4,590 % éch. 01/01/2061	£ 38	45	0,00
5,030 % éch. 01/01/2061	2 301	2 800	0,08
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust 2,925 % éch. 25/10/2047	\$ 10 448	3 287	0,10
Miravet SARL 4,265 % éch. 26/05/2065	€ 1 316	1 413	0,04
Mortimer BTL PLC 5,614 % éch. 23/06/2053	£ 2 245	2 822	0,08
New Residential Mortgage Loan Trust 3,500 % éch. 25/12/2057	\$ 937	879	0,03
Paragon Mortgages PLC 5,752 % éch. 15/05/2045	£ 108	137	0,00
Polaris PLC 5,631 % éch. 23/12/2058	2 069	2 619	0,08
Residential Accredit Loans, Inc. Trust 5,091 % éch. 25/11/2037	\$ 249	208	0,01
5,450 % éch. 25/06/2037 ^	291	259	0,01
6,000 % éch. 25/06/2036	365	291	0,01
Residential Mortgage Securities PLC 6,159 % éch. 20/06/2070	£ 1 188	1 515	0,05
RESIMAC Bastille Trust 6,093 % éch. 05/09/2057	\$ 63	63	0,00
RESIMAC Premier 6,241 % éch. 07/02/2052	742	742	0,02
Ripon Mortgages PLC 5,491 % éch. 28/08/2056	£ 13 845	17 540	0,53
RMAC Securities PLC 5,154 % éch. 12/06/2044	34	42	0,00
Sequoia Mortgage Trust 3,723 % éch. 20/07/2037	\$ 189	152	0,01
Stratton Mortgage Funding PLC 5,391 % éch. 20/07/2060	£ 3 026	3 848	0,12
5,765 % éch. 12/03/2052	2 011	2 548	0,08
5,792 % éch. 25/09/2051	2 599	3 297	0,10
Structured Asset Securities Corp. 5,430 % éch. 25/01/2036	\$ 138	109	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,440 % éch. 25/10/2036	285	239	0,01
TBW Mortgage-Backed Trust 5,965 % éch. 25/07/2037	2 345	749	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,635 % éch. 20/10/2051	£ 661	841	0,03
5,841 % éch. 20/07/2045	1 058	1 345	0,04
Trinidad Mortgage Securities PLC 5,443 % éch. 24/01/2059	92	116	0,00
Trinity Square PLC 5,316 % éch. 15/07/2059	1 720	2 184	0,07
Twin Bridges PLC 5,715 % éch. 12/03/2055	2 598	3 291	0,10
Uropa Securities PLC 4,879 % éch. 10/10/2040	258	310	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,626 % éch. 25/09/2036	\$ 59	51	0,00
3,772 % éch. 25/02/2037 ^	2 721	2 442	0,07
3,800 % éch. 25/10/2035	82	74	0,00
4,154 % éch. 25/09/2033	41	39	0,00
4,976 % éch. 25/02/2046	258	230	0,01
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 5,500 % éch. 25/04/2035	298	245	0,01
		108 059	3,23

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
TITRES ADOSÉS A DES ACTIFS											
Accunia European CLO DAC 4,127 % éch. 15/07/2030	€ 355	\$ 382	0,01	Greenwood Park CLO Ltd. 6,270 % éch. 15/04/2031	\$ 2 300	\$ 2 267	0,07	Palmer Square European Loan Funding DAC 3,897 % éch. 15/10/2031	€ 5 441	\$ 5 818	0,17
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 6,050 % éch. 25/12/2034	\$ 105	94	0,00	Griffith Park CLO DAC 4,103 % éch. 21/11/2031	€ 1 000	1 070	0,03	3,907 % éch. 15/07/2031	€ 4 114	4 383	0,13
6,050 % éch. 25/08/2035	1 413	1 357	0,04	GSAMP Trust 5,650 % éch. 25/05/2046	\$ 1 329	1 248	0,04	Pepper SPARKZ Trust 5,160 % éch. 17/08/2028	AUD 536	356	0,01
Adagio CLO DAC 3,897 % éch. 15/10/2031	€ 2 400	2 568	0,08	5,870 % éch. 25/11/2035	€ 4 200	3 398	0,10	Renaissance Home Equity Loan Trust 5,762 % éch. 25/08/2036	\$ 708	282	0,01
Apidos CLO 6,260 % éch. 20/04/2031	\$ 5 900	5 844	0,17	Harvest CLO DAC 3,817 % éch. 15/10/2031	€ 3 200	3 408	0,10	Residential Asset Securities Corp. Trust 5,810 % éch. 25/12/2035	€ 4 997	4 742	0,14
Aqueduct European CLO DAC 3,840 % éch. 20/07/2030	€ 2 381	2 564	0,08	3,880 % éch. 20/10/2031	€ 1 200	1 283	0,04	Saxon Asset Securities Trust 1,942 % éch. 25/05/2035	€ 3 041	2 795	0,08
Ares European CLO DAC 3,957 % éch. 15/10/2031	2 700	2 895	0,09	3,937 % éch. 15/07/2031	€ 3 300	3 514	0,11	4,027 % éch. 15/01/2032	€ 4 700	5 018	0,15
4,050 % éch. 20/04/2032	€ 4 100	4 389	0,13	4,250 % éch. 26/06/2030	€ 2 836	3 032	0,09	Sculptor European CLO DAC 3,916 % éch. 14/01/2032	€ 4 900	5 252	0,16
Argent Securities Trust 5,510 % éch. 25/04/2036	\$ 5 047	1 670	0,05	Home Equity Asset Trust 3,883 % éch. 25/02/2036	\$ 813	782	0,02	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,870 % éch. 25/10/2035	\$ 5 600	4 486	0,13
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 6,410 % éch. 16/01/2030	€ 2 851	2 837	0,08	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 5,370 % éch. 25/04/2037	€ 258	192	0,01	4,080 % éch. 20/07/2032	€ 2 700	2 870	0,09
Aurium CLO DAC 3,907 % éch. 16/01/2031	€ 4 793	5 129	0,15	7,100 % éch. 25/03/2035	€ 1 295	1 129	0,03	Soundview Home Loan Trust 5,555 % éch. 25/12/2036	\$ 1 396	1 357	0,04
Bain Capital Euro CLO DAC 3,940 % éch. 20/01/2032	€ 1 988	2 122	0,06	HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,290 % éch. 25/01/2037	€ 1 476	1 108	0,03	5,650 % éch. 25/11/2036	\$ 942	874	0,03
Bayview Financial Asset Trust 6,650 % éch. 25/03/2037	\$ 98	98	0,00	IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 4,100 % éch. 25/03/2035	€ 1 896	1 822	0,05	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,675 % éch. 25/07/2036	€ 1 129	1 044	0,03
Benefit Street Partners CLO Ltd. 6,350 % éch. 20/01/2031	€ 2 523	2 503	0,07	Jubilee CLO DAC 4,326 % éch. 15/12/2029	€ 352	380	0,01	Terwin Mortgage Trust 6,090 % éch. 25/11/2033	\$ 5	4	0,00
Black Diamond CLO DAC 4,303 % éch. 15/05/2032	€ 4 700	5 017	0,15	KKR CLO Ltd. 6,440 % éch. 15/01/2031	\$ 2 902	2 874	0,09	TIAA CLO Ltd. 6,450 % éch. 20/07/2031	€ 2 550	2 519	0,08
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 3,897 % éch. 15/01/2031	€ 1 988	2 125	0,06	Laurelin DAC 3,920 % éch. 20/10/2031	€ 1 500	1 607	0,05	Toro European CLO DAC 4,097 % éch. 15/07/2030	€ 312	338	0,01
4,087 % éch. 15/01/2033	2 850	3 032	0,09	Long Beach Mortgage Loan Trust 5,750 % éch. 25/01/2036	\$ 694	624	0,02	4,133 % éch. 15/02/2034	€ 5 000	5 309	0,16
BNPP AM Euro CLO DAC 4,031 % éch. 22/07/2032	€ 4 800	5 117	0,15	LT Autorahoitus DAC 4,040 % éch. 18/07/2033	€ 6 960	7 599	0,23	Venture CLO Ltd. 6,140 % éch. 15/04/2027	\$ 97	97	0,00
Bridgepoint CLO DAC 4,387 % éch. 15/01/2034	€ 3 400	3 658	0,11	Madison Park Euro Funding DAC 3,927 % éch. 15/01/2032	€ 3 200	3 418	0,10	6,350 % éch. 20/01/2029	€ 2 747	2 728	0,08
Cairn CLO BV 3,957 % éch. 15/10/2031	€ 1 300	1 390	0,04	3,977 % éch. 15/07/2032	€ 5 200	5 533	0,17	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 5,495 % éch. 25/01/2037	€ 2 678	2 566	0,08
Cairn CLO DAC 4,212 % éch. 20/10/2028	€ 20	22	0,00	Madison Park Funding Ltd. 0,000 % éch. 29/07/2030	\$ 1 976	1 969	0,06			254 511	7,61
Carlyle Euro CLO DAC 3,877 % éch. 15/01/2031	€ 2 190	2 339	0,07	Man GLG Euro CLO DAC 3,987 % éch. 15/10/2032	€ 5 194	5 520	0,17	EMISSIONS SOUVERAINES			
4,213 % éch. 15/08/2032	€ 3 000	3 199	0,10	MASTR Asset-Backed Securities Trust 5,470 % éch. 25/08/2036	\$ 12 354	4 544	0,14	Adif Alta Velocidad 0,550 % éch. 31/10/2031	€ 5 000	4 225	0,13
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,230 % éch. 17/04/2031	\$ 3 290	3 262	0,10	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 5,390 % éch. 25/02/2037	€ 633	190	0,01	Auckland Council 0,250 % éch. 17/11/2031	€ 5 000	4 236	0,13
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,073 % éch. 15/11/2031	€ 1 500	1 606	0,05	5,870 % éch. 25/05/2036	€ 206	203	0,01	Obligation internationale du gouvernement australien 0,500 % éch. 21/09/2026	AUD 5 800	3 455	0,10
Carlyle U.S. CLO Ltd. 6,440 % éch. 15/01/2030	\$ 3 609	3 578	0,11	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,220 % éch. 25/10/2036	€ 811	353	0,01	1,000 % éch. 21/12/2030	€ 2 600	1 399	0,04
Catamaran CLO Ltd. 6,373 % éch. 22/04/2030	€ 3 793	3 770	0,11	5,250 % éch. 25/11/2036	€ 5 930	2 807	0,08	1,250 % éch. 21/05/2032	\$ 1 200	635	0,02
Cedar Funding CLO Ltd. 6,360 % éch. 17/07/2031	€ 4 400	4 363	0,13	5,400 % éch. 25/07/2036	€ 61	52	0,00	1,750 % éch. 21/06/2051	€ 1 400	543	0,02
CIFC Funding Ltd. 6,440 % éch. 16/11/2030	€ 4 431	4 414	0,13	5,750 % éch. 25/12/2034	€ 478	417	0,01	4,500 % éch. 21/04/2033	€ 6 000	4 147	0,12
6,460 % éch. 17/10/2031	€ 3 200	3 170	0,10	5,825 % éch. 25/09/2035	€ 3 300	3 062	0,09	Communauté autonome d'Andalousie 0,500 % éch. 30/04/2031	€ 4 000	3 451	0,10
CIT Mortgage Loan Trust 6,500 % éch. 25/10/2037	€ 452	451	0,01	6,110 % éch. 25/09/2034	€ 680	659	0,02	Communauté autonome de Catalogne 4,220 % éch. 26/04/2035	€ 200	217	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,290 % éch. 25/07/2037	€ 2 010	1 826	0,05	Morgan Stanley Structured Trust 5,450 % éch. 25/06/2037	€ 2 798	2 555	0,08	Communauté autonome de Madrid 0,420 % éch. 30/04/2031	€ 4 200	3 614	0,11
5,370 % éch. 25/09/2037 ^	€ 182	183	0,01	Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. 6,290 % éch. 20/04/2031	€ 2 500	2 466	0,07	BNG Bank NV 0,250 % éch. 12/01/2032	€ 4 000	3 438	0,10
5,380 % éch. 25/04/2047	€ 5 700	5 188	0,16	New Century Home Equity Loan Trust 5,915 % éch. 25/02/2035	€ 2 460	2 248	0,07	3,300 % éch. 17/07/2028	AUD 3 000	1 871	0,06
5,400 % éch. 25/02/2036	€ 580	542	0,02	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 5,780 % éch. 25/08/2036	€ 4 100	3 640	0,11	Bpifrance Financement S.A. 2,000 % éch. 02/09/2030	€ 4 200	4 232	0,13
6,125 % éch. 25/01/2036	€ 2 072	2 008	0,06	NovaStar Mortgage Funding Trust 5,350 % éch. 25/01/2037	€ 2 485	871	0,03	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/12/2044 (c)	CAD 541	409	0,01
CVC Cordatus Loan Fund DAC 4,008 % éch. 27/01/2031	€ 5 633	6 034	0,18	5,690 % éch. 25/05/2036	€ 1 700	1 591	0,05	Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % éch. 05/05/2026	\$ 5 300	5 235	0,16
Dryden Euro CLO DAC 4,183 % éch. 15/05/2034	€ 1 250	1 335	0,04	OCF CLO Ltd. 6,370 % éch. 20/07/2029	€ 2 682	2 665	0,08	Obligation internationale du gouvernement chinois 3,190 % éch. 15/04/2053	CNY 28 440	4 057	0,12
Encore Credit Receivables Trust 5,840 % éch. 25/07/2035	\$ 454	433	0,01	OCF Euro CLO DAC 4,091 % éch. 22/09/2034	€ 2 700	2 869	0,09	Communauté Française de Belgique 3,750 % éch. 22/06/2033	€ 16 300	18 206	0,54
Fremont Home Loan Trust 6,215 % éch. 25/06/2035	€ 136	129	0,00	Option One Mortgage Loan Trust 5,290 % éch. 25/01/2037	\$ 256	167	0,01	CPPIB Capital, Inc. 1,500 % éch. 23/06/2028	AUD 2 300	1 306	0,04
Gallatin CLO Ltd. 6,311 % éch. 21/01/2028	€ 157	157	0,00	5,290 % éch. 25/03/2037	€ 1 174	805	0,02	Development Bank of Japan, Inc. 1,875 % éch. 02/10/2024	\$ 3 900	3 725	0,11
				5,330 % éch. 25/04/2037	€ 3 031	1 519	0,05	2,125 % éch. 01/09/2026	€ 6 000	6 232	0,19
				OZLM Ltd. 6,270 % éch. 17/07/2029	€ 1 814	1 809	0,05	Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/11/2029 (a)	€ 9 900	9 035	0,27
				6,348 % éch. 16/05/2030	€ 2 814	2 794	0,08	0,750 % éch. 25/05/2052	€ 7 700	4 581	0,14
				6,549 % éch. 30/10/2030	€ 1 064	1 060	0,03				
				Palmer Square CLO Ltd. 6,360 % éch. 16/07/2031	€ 3 500	3 470	0,10				

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF (en milliers)	JUSTE EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF (en milliers)	JUSTE EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF (en milliers)	JUSTE EN % DE L'ACTIF NET
2,000 % éch. 25/11/2032	€ 6 200	\$ 6 271	0,19	Région d'Île de France	€ 6 000	\$ 5 988	0,18	16,220 % éch. 06/07/2023	HUF 2 947 000	\$ 8 602	0,26
Obligation internationale du gouvernement hongrois	900	989	0,03	2,230 % éch. 19/07/2032	10 000	11 116	0,33	(a)(b)			
6,250 % éch. 22/02/2027	\$ 4 900	5 033	0,15	3,700 % éch. 14/06/2038				BONS DU TRÉSOR ISRAÏÏLIEN			
Obligation internationale du gouvernement israélien				République d'Allemagne	53 800	48 632	1,45	1,755 % éch. 05/07/2023	ILS 25 100	6 759	0,20
1,500 % éch. 30/11/2023	ILS 64 100	17 056	0,51	0,000 % éch. 15/08/2031 (a)				BONS DU TRÉSOR JAPONAIS			
2,000 % éch. 01/03/2027	\$ 7 800	1 966	0,06	Obligation internationale du gouvernement roumain	1 170	993	0,03	(0,211) % éch. 24/07/2023	¥ 6 894 000	47 701	1,43
3,800 % éch. 13/05/2060	\$ 1 700	1 295	0,04	1,375 % éch. 02/12/2029	200	160	0,00	(0,202) % éch. 18/07/2023	8 800 000	60 888	1,82
4,500 % éch. 17/01/2033	\$ 2 100	2 070	0,06	2,000 % éch. 14/04/2033	400	309	0,01	(a)(b)	9 848 000	68 149	2,04
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				2,124 % éch. 16/07/2031	100	83	0,00	(0,200) % éch. 28/08/2023	2 072 000	14 339	0,43
4,000 % éch. 30/10/2031	€ 20 000	22 004	0,66	2,125 % éch. 07/03/2028	14 200	13 478	0,40	(0,199) % éch. 11/09/2023	2 256 000	15 613	0,47
Obligation internationale du gouvernement italien	\$ 2 100	2 105	0,06	2,625 % éch. 02/12/2040	500	333	0,01	(0,197) % éch. 31/07/2023	3 420 000	23 664	0,71
6,875 % éch. 27/09/2023	\$ 2 100	2 105	0,06	2,750 % éch. 14/04/2041	600	403	0,01	(0,196) % éch. 14/08/2023	8 170 000	56 535	1,69
Japan Finance Organization for Municipalities	€ 3 600	3 344	0,10	2,875 % éch. 13/04/2042	2 000	1 345	0,04	(a)(b)	8 000 000	55 351	1,65
Obligation internationale du gouvernement japonais				3,750 % éch. 07/02/2034	2 100	1 857	0,06	(0,187) % éch. 10/07/2023	2 093 000	14 483	0,43
0,005 % éch. 01/03/2024	¥ 4 110 000	28 467	0,85	6,625 % éch. 27/09/2029	8 600	9 766	0,29	(a)(b)	20 330 000	140 682	4,21
0,005 % éch. 01/04/2024	1 690 000	11 707	0,35	Obligation internationale du gouvernement serbe	3 100	2 625	0,08	(0,186) % éch. 07/08/2023	2 093 000	14 483	0,43
0,005 % éch. 01/05/2024	1 370 000	9 490	0,28	1,650 % éch. 03/03/2033	3 000	2 184	0,06	(0,183) % éch. 21/08/2023	10 336 000	71 517	2,14
0,005 % éch. 01/10/2024	6 820 000	47 265	1,41	2,050 % éch. 23/09/2036	2 550	1 711	0,05	(0,182) % éch. 24/07/2023	504 000	3 488	0,10
0,100 % éch. 10/03/2028 (c)	2 944 213	21 470	0,64	Société Du Grand Paris EPIC	4 400	1 901	0,06	(0,178) % éch. 31/07/2023	970 000	6 712	0,20
0,200 % éch. 20/06/2036	500 000	3 275	0,10	0,700 % éch. 15/10/2060				(0,173) % éch. 19/09/2023	180 000	1 246	0,04
0,500 % éch. 20/09/2046	477 000	2 896	0,09	Société Nationale SNCF S.A.	5 000	5 379	0,16	(0,172) % éch. 19/09/2023	3 940 000	27 267	0,81
0,500 % éch. 20/03/2049	2 600 000	15 245	0,46	3,125 % éch. 02/11/2027				(0,168) % éch. 10/07/2023	3 610 000	24 977	0,75
0,700 % éch. 20/12/2048	132 000	817	0,02	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	34 358 800	23 126	0,69	(0,166) % éch. 07/08/2023	797 000	5 515	0,16
0,700 % éch. 20/06/2051	1 502 000	9 048	0,27	2,000 % éch. 10/06/2031	KRW 34 358 800	23 126	0,69	(0,152) % éch. 25/09/2023	4 314 000	29 856	0,89
1,300 % éch. 20/06/2052	620 000	4 331	0,13	3,250 % éch. 10/06/2033	36 353 420	26 676	0,80	(0,132) % éch. 25/09/2023	1 226 000	8 485	0,25
1,400 % éch. 20/09/2052	260 000	1 861	0,06	4,250 % éch. 10/12/2032	26 799 020	21 254	0,63				
Kommunalbanken A/S				Obligation internationale du gouvernement espagnol	€ 3 200	2 202	0,07	INSTRUMENTS À COURT TERME			
1,900 % éch. 19/01/2027	AUD 800	484	0,01	1,000 % éch. 30/07/2042	€ 3 200	2 202	0,07	BILLETTS DE TRÉSORERIE			
Korea Housing Finance Corp.	€ 1 300	1 257	0,04	1,450 % éch. 31/10/2071	500	265	0,01	AT+T, Inc.			
3,714 % éch. 11/04/2027	5 000	5 403	0,16	3,450 % éch. 30/07/2066	9 600	9 551	0,29	5,700 % éch. 19/03/2024			
4,475 % éch. 06/04/2026	AUD 10 900	7 078	0,21	Svensk Exportkredit AB	5 500	5 676	0,17	Global Payments, Inc.			
Obligation internationale du gouvernement malaisien				2,000 % éch. 30/06/2027				5,930 % éch. 28/07/2023			
2,632 % éch. 15/04/2031	MYR 9 583	1 890	0,06	Gouvernement de la métropole de Tokyo	\$ 400	388	0,01	Quanta Services, Inc.			
Émission d'investissement du gouvernement malaisien				2,625 % éch. 29/05/2024				5,900 % éch. 07/07/2023			
3,465 % éch. 15/10/2030	5 724	1 200	0,04	Bon du Trésor britannique				5,900 % éch. 10/07/2023			
Obligation internationale du gouvernement mexicain				1,250 % éch. 31/07/2051	£ 7 100	4 479	0,13	5,900 % éch. 11/07/2023			
5,000 % éch. 27/04/2051	\$ 500	435	0,01	1,500 % éch. 31/07/2053	7 500	4 980	0,15	5,900 % éch. 12/07/2023			
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap								5,900 % éch. 13/07/2023			
0,875 % éch. 21/03/2046	€ 3 800	2 418	0,07					23 634 0,71			
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais								Total des Instruments à court terme			
1,500 % éch. 15/05/2031	NZD 1 500	734	0,02					715 463 21,39			
Ontario Teachers' Finance Trust								Total des Valeurs mobilières			
0,900 % éch. 20/05/2041	€ 1 400	1 000	0,03					\$ 3 663 093 109,51			
1,850 % éch. 03/05/2032	4 000	3 802	0,11								
Obligation internationale du gouvernement péruvien											
2,780 % éch. 01/12/2060	\$ 1 500	921	0,03								
5,940 % éch. 12/02/2029	PEN 4 800	1 301	0,04								
6,150 % éch. 12/08/2032	2 100	555	0,02								
Obligation internationale du gouvernement polonais											
3,875 % éch. 14/02/2033	€ 4 200	4 552	0,14								
4,250 % éch. 14/02/2043	900	966	0,03								
4,875 % éch. 04/10/2033	\$ 2 200	2 164	0,06								
5,500 % éch. 16/11/2027	600	616	0,02								
5,500 % éch. 04/04/2053	1 600	1 614	0,05								

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
BPS	5,100 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 100	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/01/2030	\$ (102)	\$ 100	\$ 100	0,00
	5,120	30/06/2023	03/07/2023	178 000	Billets du Trésor américain 1,250 % échéance 31/05/2028	(181 598)	178 000	178 076	5,33
	5,160	30/06/2023	03/07/2023	26 400	Billets du Trésor américain 2,000 % échéance 15/08/2025	(26 963)	26 400	26 411	0,79
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	1 785	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	(1 821)	1 785	1 785	0,05
Total des Contrats de mise en pension						\$ (210 484)	\$ 206 285	\$ 206 372	6,17

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Global Bond 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 SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	741	\$ 1 986	0,06
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	329	117	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Long	06/2024	329	(74)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre	Court	09/2023	73	29	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Court	09/2023	128	53	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre	Court	09/2023	21	33	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	1 978	3 651	0,11
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	759	842	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	205	(225)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	312	417	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	15	(33)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Court	09/2023	325	358	0,01
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	1 677	393	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	15	(54)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	206	(442)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	542	(834)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	166	190	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	20	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	221	362	0,01
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	320	148	0,00
				\$ 6 916	0,21

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	76	\$ (33)	\$ (29)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	76	(27)	(4)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	98,000	15/12/2023	47	0	(2)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	47	0	(221)	(0,01)
				\$ (60)	\$ (256)	(0,01)

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 6 660 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 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	3,250 %	20/09/2053	£ 15 400	\$ (1 392)	(0,04)
À payer ⁽¹⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	195 100	(10 205)	(0,30)
À payer ⁽¹⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	22 400	(1 429)	(0,04)
À recevoir ⁽¹⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	29 900	1 100	0,03
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	16/03/2032	316 000	(248)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	15/03/2028	496 310	49	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2028	¥ 180 000	(4)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	17/03/2031	1 500 000	(74)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,035	29/11/2029	1 500 000	(57)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	3 010 000	(120)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,200	19/06/2029	1 060 000	(49)	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	19/06/2039	430 000	84	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,450	15/12/2051	890 000	252	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	360 000	71	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,000	15/03/2028	SGD 14 440	(274)	(0,01)
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,684	30/04/2025	\$ 900	29	0,00
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,696	30/04/2025	900	29	0,00
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,710	30/04/2025	1 000	32	0,00
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,714	30/04/2025	1 900	61	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,250	15/12/2023	28 500	(196)	(0,01)
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	15/12/2023	39 400	1 109	0,03
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2028	5 300	(120)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,430	31/03/2024	33 000	(266)	(0,01)
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/12/2028	20 200	(759)	(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	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500 %	15/06/2052	\$ 13 400	\$ (1 611)	(0,05)
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,518	20/01/2029	12 300	(546)	(0,02)
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,545	20/01/2029	8 200	(366)	(0,01)
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630	20/01/2029	10 300	(469)	(0,01)
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630	26/01/2029	2 300	(103)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,695	15/11/2031	42 700	(3 613)	(0,11)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	139 200	1 760	0,05
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	1 120	(15)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/12/2051	3 000	(412)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	27 180	148	0,00
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	15/12/2051	26 100	(2 952)	(0,09)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	4 050	(4)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,817	30/04/2029	18 420	1 240	0,04
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,819	30/04/2029	12 600	848	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,965	30/11/2026	122 300	6 869	0,21
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	20 570	297	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,048	15/11/2032	8 100	380	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	14 000	(604)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,070	15/11/2032	15 100	675	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,080	23/02/2053	9 600	(176)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,089	15/11/2032	100	4	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	2 400	(96)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,104	15/11/2032	9 190	385	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,106	15/11/2032	14 500	605	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,139	15/11/2032	19 600	765	0,02
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,150	13/05/2025	361 700	3 529	0,11
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,163	30/09/2029	6 800	(256)	(0,01)
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,165	03/10/2053	4 400	14	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,173	15/11/2032	24 700	905	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,174	15/11/2032	13 400	485	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,178	31/08/2027	44 100	(1 380)	(0,04)
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,200	13/05/2025	22 500	255	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,224	30/06/2024	7 091	133	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,225	30/09/2029	800	(30)	0,00
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,240	03/10/2053	4 400	75	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	5 800	(200)	(0,01)
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	20/12/2053	14 100	(51)	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,445	03/10/2038	14 300	5	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,454	30/06/2029	17 400	(308)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	4 900	(82)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/06/2030	4 400	(39)	0,00

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 recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500 %	20/12/2030	\$ 400	\$ 4	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2033	23 835	194	0,01
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,522	30/11/2027	19 640	(316)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	700	(10)	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,533	03/10/2038	14 300	(139)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	21/06/2025	38 900	739	0,02
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	20/12/2028	38 028	328	0,01
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,752	03/10/2028	18 400	(29)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	5 800	(48)	0,00
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,850	03/10/2028	18 400	51	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,898	30/06/2029	15 600	90	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,159	31/03/2025	34 000	569	0,02
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,250	20/12/2025	234 353	1 237	0,04
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,409	04/10/2024	13 400	(171)	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,409	04/10/2024	13 400	175	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,427	27/09/2024	14 200	(172)	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,427	27/09/2024	14 200	145	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,433	06/09/2024	46 500	(707)	(0,02)
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,433	06/09/2024	46 500	486	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,789	07/03/2024	6 300	(50)	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,789	07/03/2024	6 300	28	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,000	16/06/2026	CAD 20 500	(257)	(0,01)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,250	16/06/2031	19 300	(325)	(0,01)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2025	600	(4)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	27 900	(386)	(0,01)
À recevoir	Bon bancaire en CAD à 3 mois	3,250	15/03/2028	15 410	554	0,02
À payer ⁽¹⁾	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,250	20/12/2028	24 600	6	0,00
À payer	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,250	21/06/2033	46 200	199	0,01
À recevoir	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,250	21/06/2053	3 900	4	0,00
À payer ⁽¹⁾	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,500	10/05/2025	498 400	(3 051)	(0,09)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,283	14/02/2027	CHF 4 200	(179)	(0,01)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,294	10/02/2027	15 500	(663)	(0,02)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,343	16/05/2027	6 300	(263)	(0,01)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	16/03/2027	CNY 83 500	(9)	0,00
À payer	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,000	23/11/2024	€ 67 800	(1 254)	(0,04)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2028	KRW 206 689 988	(2 972)	(0,09)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2033	19 094 564	20	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	20/09/2033	23 690 080	51	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	0,528	17/03/2024	NZD 950	10	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	15/12/2023	53 500	(109)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,750	15/06/2027	35 300	(1 072)	(0,03)
À payer	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024	93 500	(1 062)	(0,03)
À payer ⁽¹⁾	BBR NZD à 3 mois	5,000	20/03/2025	54 500	(91)	0,00
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	1,000	19/06/2029	SEK 11 700	(37)	0,00
À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	15/03/2028	THB 1 080 630	365	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	15/09/2023	\$ 39 400	(510)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/09/2023	5 300	(69)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/09/2023	20 200	(211)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/07/2023	12 300	(71)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,545	20/07/2023	8 200	(46)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	20/07/2023	10 300	(54)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/07/2023	2 300	(12)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/09/2023	26 100	(240)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,409	04/07/2023	13 400	29	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,409	04/07/2023	13 400	(29)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,427	27/07/2023	14 200	(10)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,427	27/09/2023	14 200	44	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,433	06/07/2023	46 500	(81)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,433	06/09/2023	46 500	138	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,789	07/07/2023	6 300	(3)	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	LIBOR USD à 3 mois	4,789 %	07/09/2023	\$ 6 300	\$ 13	0,00
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,250	17/06/2030	AUD 4 800	33	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/03/2027	3 000	(28)	0,00
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/06/2031	6 450	87	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,000	21/06/2033	37 200	(977)	(0,03)
À payer ⁽¹⁾	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/09/2032	5 700	(25)	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/03/2033	40 300	(916)	(0,03)
À payer ⁽¹⁾	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,500	15/09/2032	207 770	321	0,01
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,913	30/01/2029	CZK 7 400	(5)	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	0,054	27/05/2050	€ 600	71	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,064	17/11/2052	1 300	219	0,01
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,250	15/09/2036	1 400	(161)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	6 000	(443)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	4 300	(316)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	3 300	(245)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	30/03/2024	130 139	(3 107)	(0,09)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	7 200	(547)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	3 500	(266)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	11/04/2024	18 200	(285)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	13/04/2024	41 200	(644)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	17/05/2024	9 300	(157)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	26/04/2024	5 800	(81)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	6 800	(101)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	6 400	(96)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037	11 890	(635)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2042	6 060	(963)	(0,03)
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	58 300	(587)	(0,02)
À payer ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	19/03/2027	136 070	(940)	(0,03)
À payer ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	327 800	(1 086)	(0,03)
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	15/03/2033	58 910	(154)	0,00
À payer ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	287 460	165	0,00
À payer ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	47 000	30	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	4,870	07/07/2025	MXN 20 400	(9)	0,00
					\$ (27 394)	(0,82)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (27 394)	(0,82)

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,180 %	11/01/2024	8 600	\$ 246	\$ 883	0,02

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % éch. 25/05/2052	€ 97,000	23/05/2025	2 200	\$ 166	\$ 917	0,03

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 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	6 200	\$ (19)	\$ (1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	6 200	(19)	(84)	0,00
	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	(247)	(1 849)	(0,06)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,380	31/07/2023	4 500	(17)	(22)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	4 500	(17)	(13)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	800	(5)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	800	(5)	(1)	0,00
BPS	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)	(842)	(0,03)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	1 000	(7)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	1 000	(7)	0	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	600	(2)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	600	(2)	(3)	0,00
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	1 700	(12)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	1 700	(12)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,100	31/08/2023	7 900	(58)	(11)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	31/08/2023	7 900	(58)	(80)	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG 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
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920 %	13/10/2023	5 600	\$ (34)	\$ (1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	5 600	(34)	(120)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	2 500	(16)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	2 500	(16)	(51)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	2 500	(18)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	2 500	(18)	(48)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	2 500	(17)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	2 500	(17)	(47)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	2 600	(18)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	2 600	(18)	(48)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	3 000	(21)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	3 000	(21)	(65)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	5 400	(39)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	5 400	(39)	(104)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	3 000	(20)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	3 000	(20)	(62)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	5 100	(19)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	5 100	(19)	(66)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	4 600	(16)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	4 600	(16)	(64)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	5 200	(16)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	5 200	(16)	(65)	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	9 300	(73)	(11)	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	9 300	(73)	(171)	(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)	(4)	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	2 800	(21)	(50)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 6 mois	À recevoir	0,820	16/12/2024	20 100	(142)	(21)	0,00
Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,250	20/07/2023	800	(3)	(1)	0,00	
Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	800	(3)	(3)	0,00	
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	9 600	(65)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	9 600	(65)	(202)	(0,01)
Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	1 900	(6)	(3)	0,00	
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	1 900	(6)	(8)	0,00
							\$ (1 599)	\$ (4 131)	(0,12)

⁽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	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000 %	20/06/2025	\$ 1 700	\$ (41)	\$ 62	\$ 21	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	1 100	(27)	40	13	0,00
					\$ (68)	\$ 102	\$ 34	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
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 14 600	\$ 11 000	\$ 72	\$ (43)	\$ 29	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	5 100	3 519	(1)	8	7	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	5 000	3 450	(9)	8	(1)	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	10 100	7 256	44	(27)	17	0,00
						\$ 106	\$ (54)	\$ 52	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 %	15/03/2028	MYR 149 702	\$ (57)	\$ 280	\$ 223	0,01
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2033	40 320	(11)	102	91	0,00
BPS	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	94 570	(38)	179	141	0,01
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,545	05/05/2028	47 895	0	56	56	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,635	05/04/2024	127 141	(29)	20	(9)	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2033	20 558	43	3	46	0,00
GST	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	8 537	(3)	16	13	0,00
SCX	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	42 080	(127)	89	(38)	0,00
						\$ (222)	\$ 745	\$ 523	0,02

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	07/2023	AUD 3 320	\$ 2 203	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	0,00
	07/2023	\$ 737	AUD 1 126	13	0	13	0,00
	08/2023	2 205	3 320	7	0	7	0,00
BOA	07/2023	AUD 8 500	\$ 5 766	108	0	108	0,00
	07/2023	CAD 50 383	37 028	0	(1 049)	(1 049)	(0,03)
	07/2023	DKK 35 412	5 114	0	(75)	(75)	0,00
	07/2023	MXN 71 776	3 899	0	(276)	(276)	(0,01)
	07/2023	NZD 5 349	3 245	0	(32)	(32)	0,00
	07/2023	\$ 3 862	AUD 5 924	81	0	81	0,00
	07/2023	2 290	CAD 3 050	15	0	15	0,00
	07/2023	20 627	DKK 140 246	0	(77)	(77)	0,00
	07/2023	1 217	€ 1 114	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	1 127	£ 886	0	0	0	0,00
	07/2023	19 499	NOK 214 349	508	0	508	0,02
	07/2023	413	PEN 1 516	5	0	5	0,00
	08/2023	CNY 1 769	\$ 258	13	0	13	0,00
	08/2023	DKK 140 012	20 627	78	0	78	0,00
	09/2023	CLP 2 908 781	3 559	0	(36)	(36)	0,00
	09/2023	¥ 4 120 000	29 662	820	0	820	0,02
	09/2023	TWD 355 331	11 705	272	0	272	0,01
	09/2023	\$ 3 601	IDR 53 909 934	0	(20)	(20)	0,00
	09/2023	8 639	INR 714 528	47	0	47	0,00
	09/2023	3	KRW 3 485	0	0	0	0,00
	09/2023	1 647	PEN 6 043	10	0	10	0,00
BPS	07/2023	AUD 4 133	\$ 2 744	1	(8)	(7)	0,00
	07/2023	CAD 2 526	1 890	0	(19)	(19)	0,00
	07/2023	€ 501 328	538 932	0	(8 018)	(8 018)	(0,24)
	07/2023	¥ 1 249 547	8 994	349	0	349	0,01
	07/2023	MYR 5 445	1 186	17	0	17	0,00
	07/2023	NOK 47 367	4 406	0	(15)	(15)	0,00
	07/2023	SGD 1 453	1 091	17	0	17	0,00
	07/2023	\$ 4 086	AUD 6 238	66	0	66	0,00
	07/2023	56	BRL 274	0	0	0	0,00
	07/2023	420	CHF 375	0	0	0	0,00
	07/2023	554 006	€ 505 576	6	(2 429)	(2 423)	(0,07)
	07/2023	4 185	£ 3 266	0	(33)	(33)	0,00
	08/2023	BRL 274	\$ 56	0	0	0	0,00
	08/2023	CHF 374	420	0	0	0	0,00
	08/2023	CNH 47 871	6 872	267	0	267	0,01
	08/2023	CNY 2 080	304	16	0	16	0,00
	08/2023	€ 486 024	533 285	2 306	0	2 306	0,07
	08/2023	TWD 177 855	5 825	114	0	114	0,00
	08/2023	\$ 1 573	AUD 2 373	8	0	8	0,00
	08/2023	1 028	CNH 7 105	0	(48)	(48)	0,00
	08/2023	4 406	NOK 47 320	16	0	16	0,00
	08/2023	1 108	TWD 33 746	0	(24)	(24)	0,00
	08/2023	54	ZAR 1 002	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	THB 20	\$ 1	0	0	0	0,00
	01/2024	DKK 79 126	11 744	13	0	13	0,00
BRC	04/2024	86 673	12 926	8	0	8	0,00
	07/2023	£ 2 553	3 169	0	(77)	(77)	0,00
	07/2023	¥ 8 800 000	68 037	7 033	0	7 033	0,21
	07/2023	MYR 1 117	243	4	0	4	0,00
	07/2023	NZD 126	76	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$ 7 779	£ 6 226	137	0	137	0,00
	08/2023	477	CNH 3 307	0	(21)	(21)	0,00
	08/2023	66	ZAR 1 212	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	IDR 182 184	\$ 12	0	0	0	0,00
	09/2023	ILS 2 726	762	25	0	25	0,00
	09/2023	\$ 456	PEN 1 669	2	0	2	0,00
	04/2024	DKK 204 732	\$ 30 585	73	0	73	0,00
	04/2024	¥ 1 690 042	13 839	1 621	0	1 621	0,05
	05/2024	1 370 000	11 081	1 132	0	1 132	0,03
BSH	07/2023	\$ 1 370	PEN 5 041	21	0	21	0,00

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	
CBK	07/2023	AUD	3 842	\$ 2 634	\$ 76	\$ 0	\$ 76	0,00
	07/2023	DKK	269 194	38 669	0	(774)	(774)	(0,02)
	07/2023	£	6 724	8 436	0	(113)	(113)	0,00
	07/2023	ILS	24 718	7 716	1 055	0	1 055	0,03
	07/2023	NZD	4 317	2 648	3	0	3	0,00
	07/2023	PEN	5 041	1 384	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	\$	1 270	AUD 1 947	26	0	26	0,00
	07/2023		7 767	€ 7 189	81	(5)	76	0,00
	07/2023		2 896	£ 2 279	1	0	1	0,00
	07/2023		830	NOK 9 334	41	0	41	0,00
	07/2023		1 877	PEN 6 875	18	0	18	0,00
	08/2023	¥	7 743 821	\$ 56 187	2 165	0	2 165	0,06
	08/2023	PEN	6 056	1 550	0	(115)	(115)	0,00
	08/2023	TWD	185 168	6 066	119	0	119	0,00
	08/2023	\$	2 620	CLP 2 170 650	76	0	76	0,00
	08/2023		1 381	PEN 5 041	6	0	6	0,00
	09/2023	CNH	66 947	\$ 9 395	135	0	135	0,00
	09/2023	KRW	68 029 122	52 906	1 058	0	1 058	0,03
	09/2023	\$	2 764	THB 95 153	0	(60)	(60)	0,00
	10/2023		14	CLP 11 090	0	0	0	0,00
	11/2023	ILS	63 106	\$ 18 857	1 739	0	1 739	0,05
FAR	07/2023	\$	786	CLP 624 125	0	(9)	(9)	0,00
GLM	07/2023	BRL	86 425	\$ 17 899	0	(17)	(17)	0,00
	07/2023	NOK	292 134	27 103	0	(165)	(165)	0,00
	07/2023	\$	15 994	BRL 86 151	1 864	0	1 864	0,06
	08/2023	CNH	66 533	\$ 9 532	352	0	352	0,01
	08/2023	\$	27 103	NOK 291 846	165	0	165	0,01
	09/2023	TWD	275 377	\$ 9 048	188	0	188	0,01
	09/2023	\$	17 899	BRL 87 382	14	0	14	0,00
	09/2023		16 105	SGD 21 536	0	(146)	(146)	0,00
	09/2023		5 321	THB 183 133	0	(117)	(117)	0,00
JPM	07/2023	SGD	5 876	\$ 4 448	104	0	104	0,00
	07/2023	\$	2 833	AUD 4 333	51	0	51	0,00
	07/2023		1 071	CAD 1 421	3	0	3	0,00
	07/2023		3 366	¥ 481 344	0	(35)	(35)	0,00
	07/2023		272	SGD 359	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	CNH	29 416	\$ 4 126	69	0	69	0,00
	08/2023	CNY	2 194	321	17	0	17	0,00
	08/2023	¥	4 655 478	33 642	1 178	0	1 178	0,04
	08/2023	\$	825	CNH 5 703	0	(39)	(39)	0,00
	08/2023		506	HUF 174 852	1	(2)	(1)	0,00
	09/2023	IDR	9 170	\$ 1	0	0	0	0,00
	09/2023	ILS	2 616	736	30	0	30	0,00
	09/2023	KRW	25 286 558	19 528	256	0	256	0,01
	09/2023	PEN	26 331	7 151	0	(69)	(69)	0,00
	09/2023	\$	1 499	IDR 22 550 990	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023		14	KRW 18 517	0	0	0	0,00
	09/2023		1 656	SGD 2 215	0	(15)	(15)	0,00
	09/2023		3 353	THB 114 991	0	(86)	(86)	0,00
	10/2023		221	MXN 3 875	1	0	1	0,00
	12/2023		15 647	INR 1 291 210	0	(6)	(6)	0,00
MBC	10/2024	¥	4 060 000	\$ 32 677	2 563	0	2 563	0,08
	07/2023	AUD	2 337	1 542	0	(14)	(14)	0,00
	07/2023	€	17 442	18 868	16	(177)	(161)	0,00
	07/2023	£	85 166	105 917	88	(2 449)	(2 361)	(0,07)
	07/2023	¥	17 230 000	131 929	12 378	0	12 378	0,37
	07/2023	SGD	394	293	2	0	2	0,00
	07/2023	\$	30 705	CAD 40 857	193	(22)	171	0,01
	07/2023		3 763	€ 3 516	73	0	73	0,00
	07/2023		5 867	£ 4 708	118	0	118	0,00
	08/2023	CNH	128 902	\$ 18 114	336	0	336	0,01
	08/2023	¥	20 330 000	148 815	7 145	0	7 145	0,21
	09/2023		2 760 000	20 105	808	0	808	0,02
	09/2023	\$	5	KRW 6 461	0	0	0	0,00
	10/2023	DKK	178 828	\$ 26 437	90	0	90	0,00
	03/2024	¥	4 110 103	33 566	4 001	0	4 001	0,12
	10/2024		2 760 000	22 134	1 663	0	1 663	0,05
MYI	07/2023	CHF	164	184	1	0	1	0,00
	07/2023	€	7 808	8 511	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	£	2 650	3 296	0	(73)	(73)	0,00
	07/2023	IDR	14 211 310	950	2	0	2	0,00
	07/2023	MYR	372	81	1	0	1	0,00
	07/2023	NZD	355	215	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$	3 265	AUD 4 877	0	(18)	(18)	0,00
	07/2023		10	CHF 9	0	0	0	0,00
	07/2023		18 336	DKK 125 075	0	(9)	(9)	0,00
	07/2023		3 513	£ 2 771	13	(3)	10	0,00
	07/2023		946	IDR 14 211 310	2	0	2	0,00
	08/2023	DKK	124 866	\$ 18 336	10	0	10	0,00
	08/2023	TWD	192 093	6 334	165	0	165	0,00
	09/2023	\$	4 703	IDR 70 272 753	0	(35)	(35)	0,00
	09/2023		1 531	THB 52 416	0	(41)	(41)	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	DKK	\$	86 200	12 983	\$ 136	0,00
RBC	07/2023	\$	CAD	1 307	1 718	0	0,00
	08/2023		MXN	24	412	0	0,00
RYL	07/2023	NOK	\$	20 615	1 938	14	0,00
	04/2024	DKK		55 000	8 260	63	0,00
SCX	07/2023	AUD		4 877	3 237	0	0,00
	07/2023	CHF		230	256	0	0,00
	07/2023	MYR		5 445	1 185	16	0,00
	07/2023	NZD		13 931	8 459	0	0,00
	07/2023	\$	AUD	3 997	6 116	75	0,00
	07/2023		CAD	2 773	3 767	73	0,00
	07/2023		£	151	120	1	0,00
	08/2023	CNH	\$	39	5	0	0,00
	08/2023	CNY		5 826	853	47	0,00
	08/2023	\$	AUD	3 240	4 877	9	0,00
	08/2023		CNH	393	2 703	0	0,00
	09/2023	CNH	\$	23 105	3 238	42	0,00
	09/2023	IDR		9 080 446	611	8	0,00
	09/2023	TWD		296 912	9 739	186	0,01
	09/2023	\$	IDR	4 547	68 245 498	0	0,00
	09/2023		PEN	862	3 174	9	0,00
	09/2023		THB	7 994	275 894	0	0,00
SSB	07/2023	CLP	\$	625 020	778	0	0,00
	07/2023	¥		4 390 000	33 289	2 797	0,08
	08/2023			8 170 000	61 547	4 678	0,14
	08/2023	\$	CLP	778	626 825	0	0,00
TOR	07/2023	AUD	\$	6 001	3 964	0	0,00
	07/2023	¥		163 900	1 173	39	0,00
	07/2023	\$	AUD	2 574	3 935	46	0,00
	07/2023		CAD	2 658	3 518	2	0,00
	07/2023		£	100 015	78 708	51	0,00
	07/2023		¥	6 472	932 039	0	0,00
	07/2023		NZD	14 664	24 079	88	0,00
	08/2023	CAD	\$	3 516	2 658	2	0,00
	08/2023	£		78 708	100 037	0	0,00
	08/2023	¥		928 086	6 472	24	0,00
	08/2023	NZD		24 079	14 663	0	0,00
	08/2023	\$	AUD	3 967	6 001	31	0,00
	08/2023		HUF	43	15 108	1	0,00
	09/2023	¥	\$	5 540 000	39 318	498	0,02
UAG	07/2023	AUD		9 565	6 387	33	0,00
	07/2023	¥		11 610 000	88 565	8 180	0,24
	07/2023	\$	AUD	6 529	9 671	10	0,00
	07/2023		NOK	13 550	149 935	445	0,01
	08/2023	¥	\$	2 890 000	21 321	1 227	0,04
	08/2023	\$	AUD	6 392	9 565	13	0,00
	09/2023	CNH	THB	22 152	107 282	0	0,00
	09/2023	ILS	\$	2 264	632	21	0,00
	09/2023	SGD		16 778	12 554	121	0,00
	09/2023	\$	INR	8 177	675 966	40	0,00
						\$ 74 815	1,71
						\$ (17 549)	
						\$ 57 266	

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	\$	21 400	14 201	\$ 0	0,00
	07/2023	\$	AUD	27 340	41 777	468	0,01
	08/2023			14 212	21 400	44	0,00
BOA	07/2023			83 801	128 959	2 044	0,06
BPS	07/2023	AUD	\$	111 692	73 962	0	0,01
	07/2023	\$	AUD	573	856	2	0,00
	08/2023			72 713	109 690	361	0,01
CBK	07/2023			18 100	27 689	352	0,01
JPM	07/2023			26 415	40 404	480	0,01
MYI	07/2023			283	423	0	0,00
RBC	07/2023			1 202	1 811	16	0,00
SCX	07/2023	AUD	\$	37 749	25 059	0	0,00
	07/2023	\$	AUD	21 031	32 184	393	0,01
	08/2023			25 079	37 749	68	0,00
TOR	07/2023	AUD	\$	65 910	43 534	0	0,01
	07/2023	\$	AUD	44 551	68 116	790	0,02
	08/2023			43 569	65 910	339	0,01
UAG	07/2023	AUD	\$	136 580	90 811	270	0,00
	07/2023	\$	AUD	32 533	49 695	547	0,02
	08/2023			84 539	127 220	373	0,01
						\$ 6 547	0,15
						\$ (1 414)	
						\$ 5 133	

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$ 1 498	CHF 1 341	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	07/2023	CHF 186 865	\$ 208 940	70	0	70	0,00
	07/2023	\$ 270 701	CHF 244 893	3 029	0	3 029	0,09
	08/2023	208 940	186 334	0	(71)	(71)	0,00
MBC	07/2023	3 086	2 776	16	0	16	0,00
MYI	07/2023	CHF 2 562	\$ 2 830	0	(33)	(33)	0,00
	07/2023	\$ 2 190	CHF 1 977	20	0	20	0,00
RBC	07/2023	301	269	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07/2023	390	351	2	0	2	0,00
SCX	07/2023	198 215	178 112	871	0	871	0,03
UAG	07/2023	CHF 193 036	\$ 215 342	0	(425)	(425)	(0,01)
	07/2023	\$ 179 536	CHF 161 317	777	0	777	0,02
	08/2023	215 342	192 486	424	0	424	0,01
				\$ 5 210	\$ (530)	\$ 4 680	0,14

Au 30 juin 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 et Institutions en GBP (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
BOA	07/2023	CLP 548	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	DKK 5	1	0	0	0	0,00
	07/2023	HUF 313	1	0	0	0	0,00
	07/2023	PEN 2	0	0	0	0	0,00
	07/2023	PLN 6	1	0	0	0	0,00
	07/2023	SEK 31	3	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 7	AUD 11	0	0	0	0,00
	07/2023	23	CAD 31	1	0	1	0,00
	07/2023	0	CHF 0	0	0	0	0,00
	07/2023	1	CLP 548	0	0	0	0,00
	07/2023	1	CNY 4	0	0	0	0,00
	07/2023	1	COP 2 479	0	0	0	0,00
	07/2023	1	DKK 10	0	0	0	0,00
	07/2023	178	€ 166	3	0	3	0,00
	07/2023	97	¥ 13 439	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	0	KRW 241	0	0	0	0,00
	07/2023	0	NOK 3	0	0	0	0,00
	07/2023	1	NZD 2	0	0	0	0,00
	07/2023	1	PEN 5	0	0	0	0,00
	07/2023	0	SEK 0	0	0	0	0,00
	07/2023	4	THB 128	0	0	0	0,00
	08/2023	THB 128	\$ 4	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 1	CLP 548	0	0	0	0,00
	08/2023	1	DKK 5	0	0	0	0,00
	08/2023	1	HUF 316	0	0	0	0,00
	08/2023	0	PEN 2	0	0	0	0,00
	08/2023	1	PLN 6	0	0	0	0,00
	08/2023	3	SEK 31	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	€ 166	\$ 180	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	MXN 47	3	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 2	AUD 3	0	0	0	0,00
	07/2023	2	CNY 14	0	0	0	0,00
	07/2023	0	COP 419	0	0	0	0,00
	07/2023	0	DKK 0	0	0	0	0,00
	07/2023	32	£ 25	1	0	1	0,00
	07/2023	0	¥ 21	0	0	0	0,00
	07/2023	3	MXN 47	0	0	0	0,00
	07/2023	0	NOK 0	0	0	0	0,00
	07/2023	0	NZD 0	0	0	0	0,00
	07/2023	3	SEK 30	0	0	0	0,00
	08/2023	181	€ 166	1	0	1	0,00
	08/2023	3	MXN 47	0	0	0	0,00
GLM	07/2023	COP 2 898	\$ 1	0	0	0	0,00
	07/2023	IDR 80	0	0	0	0	0,00
	07/2023	MYR 14	3	0	0	0	0,00
	07/2023	NOK 5	0	0	0	0	0,00
	07/2023	PEN 3	1	0	0	0	0,00
	07/2023	THB 128	4	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 1	CHF 1	0	0	0	0,00
	07/2023	1	¥ 112	0	0	0	0,00
	07/2023	3	MYR 14	0	0	0	0,00
	07/2023	1	PLN 6	0	0	0	0,00
	07/2023	0	RON 2	0	0	0	0,00
	07/2023	0	SGD 0	0	0	0	0,00
	08/2023	1	COP 2 898	0	0	0	0,00
	08/2023	3	MYR 14	0	0	0	0,00
	08/2023	0	NOK 5	0	0	0	0,00
UAG	07/2023	AUD 18	\$ 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
	07/2023	CHF 4	\$ 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	ILS 4	1	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 3	AUD 4	0	0	0	0,00
	07/2023	0	CAD 0	0	0	0	0,00
	07/2023	3	CHF 3	0	0	0	0,00
	07/2023	73	CNY 512	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	1	CZK 26	0	0	0	0,00
	07/2023	1	HUF 313	0	0	0	0,00
	07/2023	4	IDR 56 540	0	0	0	0,00
	07/2023	1	ILS 4	0	0	0	0,00
	07/2023	9	KRW 11 944	0	0	0	0,00
	07/2023	0	NOK 3	0	0	0	0,00
	07/2023	0	RON 0	0	0	0	0,00
	07/2023	2	SGD 2	0	0	0	0,00
	08/2023	12	AUD 18	0	0	0	0,00
	08/2023	4	CHF 4	0	0	0	0,00
	08/2023	1	ILS 4	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ (7)	\$ (1)	0,00

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 1 003	\$ 1 092	\$ 1	\$ (3)	\$ (2)	0,00
	07/2023	\$ 362 446	€ 337 252	5 495	0	5 495	0,16
BPS	07/2023	€ 324 064	\$ 355 076	1 522	0	1 522	0,05
	07/2023	\$ 369 879	€ 343 954	5 384	(10)	5 374	0,16
	08/2023	\$ 355 295	€ 323 808	0	(1 535)	(1 535)	(0,05)
CBK	07/2023	€ 374 130	\$ 405 991	0	(2 185)	(2 185)	(0,07)
	07/2023	\$ 2 967	€ 2 747	30	(1)	29	0,00
	08/2023	\$ 347 432	€ 319 116	1 200	0	1 200	0,04
JPM	07/2023	€ 325 951	\$ 355 906	293	0	293	0,01
	07/2023	\$ 364 302	€ 340 734	7 439	0	7 439	0,22
	08/2023	\$ 356 403	€ 325 951	0	(304)	(304)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 2 698	\$ 2 890	0	(54)	(54)	0,00
	07/2023	\$ 770	€ 716	12	(1)	11	0,00
SCX	07/2023	\$ 9 670	€ 9 036	188	0	188	0,01
				\$ 21 564	\$ (4 093)	\$ 17 471	0,52

Au 30 juin 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	07/2023	£ 1 078	\$ 1 370	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
BPS	07/2023	\$ 278	£ 346	1	(8)	(7)	0,00
	07/2023	\$ 122 460	£ 99 007	3 412	0	3 412	0,10
BRC	07/2023	£ 1 485	\$ 1 880	1	(9)	(8)	0,00
	07/2023	\$ 338	£ 273	8	0	8	0,00
CBK	07/2023	£ 10 059	\$ 12 781	1	(9)	(8)	0,00
	07/2023	\$ 2 397	£ 1 911	33	0	33	0,00
JPM	07/2023	£ 94 765	\$ 119 821	0	(659)	(659)	(0,02)
	08/2023	\$ 119 847	£ 94 765	657	0	657	0,02
MBC	07/2023	£ 229	\$ 293	2	0	2	0,00
	07/2023	\$ 122 876	£ 99 258	3 315	0	3 315	0,10
MYI	07/2023	\$ 122 052	£ 98 202	2 798	0	2 798	0,09
TOR	07/2023	£ 94 962	\$ 120 668	0	(62)	(62)	0,00
	08/2023	\$ 120 694	£ 94 962	60	0	60	0,00
				\$ 10 288	\$ (748)	\$ 9 540	0,29

Au 30 juin 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	07/2023	NOK 1 767	\$ 166	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2023	\$ 247 051	NOK 2 734 562	8 196	(4)	8 192	0,25
BPS	07/2023	NOK 1 545 613	\$ 143 765	0	(501)	(501)	(0,01)
	07/2023	\$ 354	NOK 3 886	9	0	9	0,00
	08/2023	\$ 143 765	NOK 1 544 092	506	0	506	0,02
CBK	07/2023	\$ 122 445	NOK 1 373 378	5 744	0	5 744	0,17
GLM	07/2023	NOK 1 634 758	\$ 151 669	0	(919)	(919)	(0,03)
	08/2023	\$ 151 669	NOK 1 633 151	924	0	924	0,03
MBC	07/2023	\$ 5 529	NOK 60 386	107	0	107	0,00
MYI	07/2023	\$ 183	NOK 1 980	2	0	2	0,00
RYL	07/2023	\$ 1 746	NOK 18 810	10	0	10	0,00
SCX	07/2023	\$ 1 123	NOK 12 123	9	0	9	0,00

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
TOR	07/2023	\$ 3 566	NOK 39 483	\$ 119	\$ 0	\$ 119	0,00
UAG	07/2023	154 376	1 708 238	5 071	0	5 071	0,15
				\$ 20 698	\$ (1 424)	\$ 19 274	0,58

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 12 158	NZD 20 039	\$ 119	\$ 0	\$ 119	0,00
BRC	07/2023	NZD 22 129	\$ 13 456	0	(101)	(101)	0,00
	07/2023	\$ 8 950	NZD 14 909	183	0	183	0,01
	08/2023	13 455	22 129	101	0	101	0,00
CBK	07/2023	NZD 302	\$ 182	0	(3)	(3)	0,00
MYI	07/2023	\$ 9 796	NZD 16 186	120	0	120	0,00
RYL	07/2023	1	1	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	9 349	15 398	85	0	85	0,00
				\$ 608	\$ (104)	\$ 504	0,01

Au 30 juin 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	07/2023	SEK 187 093	\$ 17 421	\$ 100	\$ (1)	\$ 99	0,00
	07/2023	\$ 97	SEK 1 056	1	0	1	0,00
	08/2023	4 636	49 970	0	(4)	(4)	0,00
BRC	07/2023	SEK 79 891	\$ 7 475	79	0	79	0,00
	07/2023	\$ 304	SEK 3 255	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07/2023	SEK 51 306	\$ 4 768	18	0	18	0,00
	07/2023	\$ 10 071	SEK 110 001	113	0	113	0,01
GLM	07/2023	SEK 93	\$ 9	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 33	SEK 357	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	9 500	102 313	0	(28)	(28)	0,00
MYI	07/2023	SEK 101 359	\$ 9 404	20	0	20	0,00
	07/2023	\$ 14 104	SEK 151 418	0	(86)	(86)	0,00
	08/2023	4 636	49 991	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07/2023	SEK 1 845	\$ 171	1	(1)	0	0,00
	07/2023	\$ 9 535	SEK 103 135	13	0	13	0,00
				\$ 345	\$ (125)	\$ 220	0,01

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 112 365 3,36

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. 01/07/2038	\$ 29 000	\$ (25 701)	(0,77)
2,000 % éch. 01/08/2053	114 550	(93 578)	(2,79)
4,000 % éch. 01/08/2053	5 300	(4 978)	(0,15)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (124 257)	(3,71)
Total des Investissements		\$ 3 836 752	114,71
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (491 918)	(14,71)
Actifs nets		\$ 3 344 834	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) Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 78 239 \$ (31 décembre 2022 : 78 217 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 370 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 3 663 012	\$ 81	\$ 3 663 093
Contrats de mise en pension	0	206 285	0	206 285
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	5 612	86 019	0	91 631
Titres vendus à découvert	0	(124 257)	0	(124 257)
Totaux	\$ 5 612	\$ 3 831 059	\$ 81	\$ 3 836 752

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 510	\$ (370)	\$ 140	\$ 569	\$ (270)	\$ 299
BOA	15 557	(11 790)	3 767	(19 412)	16 030	(3 382)
BOM	S/O	S/O	S/O	68	0	68
BPS	4 605	(3 010)	1 595	(119)	70	(49)
BRC	10 201	(9 860)	341	511	(350)	161
BSH	21	0	21	S/O	S/O	S/O
CBK	10 820	(10 210)	610	21 756	(21 180)	576
FAR	(100)	320	220	S/O	S/O	S/O
GLM	1 253	(1 200)	53	(1 813)	1 600	(213)
GSC	S/O	S/O	S/O	(6)	0	(6)
GST	13	0	13	(69)	70	1
HUS	S/O	S/O	S/O	(2)	0	(2)
JPM	11 895	(10 640)	1 255	634	(560)	74
MBC	27 618	(27 110)	508	(11 665)	10 830	(835)
MYC	(198)	50	(148)	(127)	50	(77)
MYI	2 978	(2 070)	908	(1 837)	1 310	(527)
RBC	(6)	0	(6)	128	0	128
RYL	89	0	89	(29)	0	(29)
SCX	1 713	(1 100)	613	9 488	(8 580)	908
SSB	7 475	(7 620)	(145)	488	(420)	68
TOR	1 493	(1 050)	443	(8 559)	7 570	(989)
UAG	16 428	(14 040)	2 388	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	60,44	34,52
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	49,07	58,42
Autres valeurs mobilières	S/O	0,85
Fonds d'investissement	S/O	0,18
Contrats de mise en pension	6,17	37,28
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,20	0,30
Instruments financiers dérivés compensés	(0,82)	(1,56)
Instruments financiers dérivés hors cote	3,36	(0,59)
Titres vendus à découvert	(3,71)	(3,83)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	19,46	15,77
Obligations et billets municipaux	0,11	0,00
Agences du gouvernement américain	34,82	16,84
Obligations du Trésor américain	6,40	3,33
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	3,23	3,93
Titres adossés à des actifs	7,61	8,18
Émissions souveraines	16,49	10,32
Titres privilégiés	S/O	0,00
Instruments à court terme	21,39	35,42
Fonds d'investissement	S/O	0,18
Contrats de mise en pension	6,17	37,28
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,21	0,30
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	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	(0,82)	(1,56)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,02	0,03
Options sur titres	0,03	0,03
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,12)	(0,15)
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 sur devises croisées	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,02	(0,01)
Contrats de change à terme	1,71	(1,97)
Contrats de change à terme couverts	1,70	1,48
Titres vendus à découvert	(3,71)	(3,83)
Autres actifs et passifs à court terme	(14,71)	(25,57)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AerCap Ireland Capital DAC			
1,150 % éch. 29/10/2023	\$ 600	\$ 590	0,08
1,650 % éch. 29/10/2024	500	470	0,06
1,750 % éch. 29/10/2024	500	470	0,06
	1 530	0,20	

Total Irlande

46 172 6,31

ISRAËL

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement israélien			
0,150 % éch. 31/07/2023	ILS 13 100	3 517	0,48
1,500 % éch. 30/11/2023	11 000	2 927	0,40
2,000 % éch. 31/03/2027	7 600	1 916	0,26
4,500 % éch. 17/01/2033	\$ 500	493	0,07
	8 853	1,21	

ITALIE

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

AMCO - Asset Management Co. SpA			
1,500 % éch. 17/07/2023	€ 777	847	0,12
4,625 % éch. 06/02/2027	1 100	1 193	0,16
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			
0,875 % éch. 08/10/2027	200	195	0,03
2,000 % éch. 29/01/2024	2 200	2 369	0,32
2,625 % éch. 28/04/2025	100	102	0,01
UniCredit SpA			
7,830 % éch. 04/12/2023	\$ 2 800	2 817	0,39
	7 523	1,03	

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Cassa Depositi e Prestiti SpA			
5,750 % éch. 05/05/2026	1 100	1 086	0,15
Obligation internationale du gouvernement italien			
6,000 % éch. 04/08/2028	€ 100	124	0,02
	1 210	0,17	

Total Italie

8 733 1,20

JAPON

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Mizuho Financial Group, Inc.			
3,922 % éch. 11/09/2024	\$ 1 000	995	0,14
6,540 % éch. 11/09/2024	1 500	1 502	0,21
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
0,409 % éch. 07/11/2029	€ 1 800	1 602	0,22
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
0,010 % éch. 15/10/2027	2 000	1 854	0,25
	5 953	0,82	

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement japonais			
0,005 % éch. 01/03/2024	¥ 620 000	4 294	0,59
0,005 % éch. 01/04/2024	690 000	4 780	0,66
0,005 % éch. 01/05/2024	310 000	2 147	0,29
0,005 % éch. 01/10/2024	1 320 000	9 148	1,25
0,100 % éch. 10/03/2028 (d)	1 024 212	7 469	1,02
0,500 % éch. 20/03/2049	976 000	5 723	0,78
0,700 % éch. 20/12/2048	1 188 000	7 353	1,01
0,700 % éch. 20/09/2051	660 000	3 972	0,54
Gouvernement de la métropole de Tokyo			
0,750 % éch. 16/07/2025	\$ 800	730	0,10
	45 616	6,24	

Total Japon

51 569 7,06

LUXEMBOURG

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Aroundtown S.A.			
0,000 % éch. 16/07/2026 (b)	€ 700	586	0,08
0,375 % éch. 15/04/2027	100	78	0,01
CPI Property Group S.A.			
2,750 % éch. 12/05/2026	2 100	1 865	0,26
Cromwell Ereit Lux Finco SARL			
2,125 % éch. 19/11/2025	500	471	0,07

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Logicor Financing SARL			
0,625 % éch. 17/11/2025	€ 1 400	\$ 1 340	0,18
		4 340	0,60

TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

Miravet SARL			
4,265 % éch. 26/05/2065	900	967	0,13
Total Luxembourg			
		5 307	0,73

MALAISIE

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Petronas Capital Ltd.			
2,480 % éch. 28/01/2032	\$ 400	334	0,04
3,500 % éch. 21/04/2030	400	370	0,05
4,550 % éch. 21/04/2050	300	276	0,04
4,800 % éch. 21/04/2060	300	283	0,04
	1 263	0,17	

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement malaisien			
2,632 % éch. 15/04/2031	MYR 2 157	425	0,06
3,885 % éch. 15/08/2029	10 179	2 198	0,30
Émission d'investissement du gouvernement malaisien			
3,465 % éch. 15/10/2030	3 002	629	0,09
	3 252	0,45	
Total Malaisie			
		4 515	0,62

MEXIQUE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement mexicain			
4,000 % éch. 15/03/2115	€ 400	323	0,04

MULTINATIONALES

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Preferred Term Securities Ltd.			
5,914 % éch. 23/06/2035	\$ 849	798	0,11

PAYS-BAS

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Coöperatieve Rabobank UA			
3,758 % éch. 06/04/2033	600	522	0,07
CTP NV			
0,625 % éch. 27/09/2026	€ 600	529	0,07
0,875 % éch. 20/01/2026	900	839	0,12
1,500 % éch. 27/09/2031	600	457	0,06
ING Groep NV			
2,125 % éch. 23/05/2026	400	416	0,06
	2 763	0,38	

TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

Jubilee Place BV			
4,177 % éch. 17/10/2057	887	967	0,13
Total Pays-Bas			
		3 730	0,51

NOUVELLE-ZÉLANDE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais			
1,500 % éch. 15/05/2031	NZD 1 300	636	0,09

NORVÈGE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Kommunalbanken A/S			
1,900 % éch. 19/01/2027	AUD 1 600	968	0,13
Obligation internationale du gouvernement norvégien			
1,750 % éch. 13/03/2025	NOK 6 300	565	0,08
Total Norvège			
		1 533	0,21

PÉROU

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Banco de Credito del Peru S.A.			
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN 2 400	635	0,09

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement péruvien			
6,150 % éch. 12/08/2032	PEN 100	\$ 26	0,00
Total Pérou			
		661	0,09

POLOGNE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement polonais			
3,875 % éch. 14/02/2033	€ 900	975	0,13
4,250 % éch. 14/02/2043	200	215	0,03
4,875 % éch. 04/10/2033	\$ 500	492	0,07
5,500 % éch. 16/11/2027	200	205	0,03
5,500 % éch. 04/04/2053	400	404	0,05
Total Pologne			
		2 291	0,31

PORTUGAL

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Banco Espírito Santo S.A.			
4,000 % éch. 21/01/2019 ^	€ 400	107	0,01
4,750 % éch. 15/01/2018 ^	700	187	0,03
EDP - Energias de Portugal S.A.			
2,375 % éch. 27/11/2023	800	867	0,12
Total Portugal			
		1 161	0,16

QATAR

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

QatarEnergy			
2,250 % éch. 12/07/2031	\$ 400	336	0,05

ROUMANIE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement roumain			
1,375 % éch. 02/12/2029	€ 630	534	0,07
1,750 % éch. 13/07/2030	1 000	834	0,11
2,000 % éch. 28/01/2032	600	481	0,07
2,000 % éch. 14/04/2033	700	541	0,07
2,124 % éch. 16/07/2031	400	332	0,05
2,625 % éch. 02/12/2040	600	400	0,05
2,875 % éch. 13/04/2042	800	538	0,07
3,750 % éch. 07/02/2034	800	707	0,10
5,000 % éch. 27/09/2026	1 700	1 864	0,26
Total Roumanie			
		6 231	0,85

ARABIE SAOUDITE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite			
3,250 % éch. 22/10/2030	\$ 400	363	0,05
4,750 % éch. 18/01/2028	1 900	1 886	0,26
4,875 % éch. 18/07/2033	2 200	2 201	0,30
Total Arabie saoudite			
		4 450	0,61

SERBIE

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement serbe			
1,000 % éch. 23/09/2028	€ 600	508	0,07
2,050 % éch. 23/09/2036	900	604	0,08
Total Serbie			
		1 112	0,15

SINGAPOUR

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.			
4,650 % éch. 19/05/2030	\$ 600	593	0,08

SLOVÉNIE

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Nova Kreditna Banka Maribor d.d.			
1,875 % éch. 27/01/2025	€ 700	739	0,10
Nova Ljubljanska Banka d.d.			
3,400 % éch. 05/02/2030	1 000	927	0,13
Total Slovénie			
		1 666	0,23

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CORÉE DU SUD			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen			
2,000 % éch. 10/06/2031	KRW 1 769 360	\$ 1 191	0,16
2,125 % éch. 10/06/2027	2 095 000	1 501	0,21
2,375 % éch. 10/12/2027	2 480 000	1 783	0,24
2,375 % éch. 10/12/2028	10 348 000	7 350	1,01
2,625 % éch. 10/06/2028	4 190 000	3 030	0,41
3,250 % éch. 10/06/2033	4 800 300	3 523	0,48
4,250 % éch. 10/12/2032	10 509 430	8 335	1,14
5,500 % éch. 10/03/2028	2 480 000	2 030	0,28
Total Corée du Sud		28 743	3,93

ESPAGNE			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS			
BBVA Consumer Auto			
0,270 % éch. 20/07/2031	€ 342	363	0,05

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Santander S.A.			
1,849 % éch. 25/03/2026	\$ 200	179	0,03
CaixaBank S.A.			
1,750 % éch. 24/10/2023	€ 900	975	0,13
		1 154	0,16

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Communauté autonome de Catalogne			
4,220 % éch. 26/04/2035	400	433	0,06
Obligation internationale du gouvernement espagnol			
1,450 % éch. 31/10/2071	2 200	1 165	0,16
1,900 % éch. 31/10/2052	300	217	0,03
3,450 % éch. 30/07/2066	4 200	4 179	0,57
5,250 % éch. 06/04/2029	£ 500	622	0,08
		6 616	0,90
Total Espagne		8 133	1,11

SUPRANATIONALES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banque européenne pour la reconstruction et le développement			
0,500 % éch. 21/12/2023	AUD 3 100	2 021	0,28
Banque européenne d'investissement			
0,500 % éch. 21/07/2023	1 200	797	0,11
Banque interaméricaine de développement			
2,500 % éch. 14/04/2027	1 300	804	0,11
Total Supranationales		3 622	0,50

SUÈDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
EQT AB			
2,375 % éch. 06/04/2028	€ 700	674	0,09

SUISSE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Credit Suisse AG			
3,625 % éch. 09/09/2024	\$ 500	482	0,07
6,500 % éch. 08/08/2023 (f)	700	698	0,10
UBS Group AG			
0,650 % éch. 10/09/2029	€ 700	600	0,08
3,869 % éch. 12/01/2029	\$ 1 150	1 041	0,14
4,282 % éch. 09/01/2028	450	416	0,06
4,488 % éch. 12/05/2026	400	387	0,05
4,550 % éch. 17/04/2026	750	721	0,10
6,373 % éch. 15/07/2026	1 250	1 242	0,17
6,442 % éch. 11/08/2028	1 100	1 105	0,15
7,750 % éch. 01/03/2029	€ 600	726	0,10
9,016 % éch. 15/11/2033	\$ 1 300	1 559	0,21
Total Suisse		8 977	1,23

ÉMIRATS ARABES UNIS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
MDGM GMTN RSC Ltd.			
5,500 % éch. 28/04/2033	500	526	0,07

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Barclays PLC			
4,375 % éch. 12/01/2026	\$ 200	\$ 192	0,03
6,224 % éch. 09/05/2034	2 300	2 292	0,31
Haleon UK Capital PLC			
3,125 % éch. 24/03/2025	1 200	1 147	0,16
HSBC Holdings PLC			
2,251 % éch. 22/11/2027	2 300	2 043	0,28
2,804 % éch. 24/05/2032	2 200	1 780	0,24
2,999 % éch. 10/03/2026	500	474	0,06
4,041 % éch. 13/03/2028	300	281	0,04
4,583 % éch. 19/06/2029	1 300	1 225	0,17
NatWest Markets PLC			
1,000 % éch. 28/05/2024	€ 1 000	1 061	0,15
Santander UK Group Holdings PLC			
4,796 % éch. 15/11/2024	\$ 1 700	1 687	0,23
Standard Chartered PLC			
1,822 % éch. 23/11/2025	1 800	1 684	0,23
2,678 % éch. 29/06/2032	2 700	2 118	0,29
TP ICAP Finance PLC			
2,625 % éch. 18/11/2028	£ 700	658	0,09
		16 642	2,28

TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Avon Finance PLC			
5,809 % éch. 20/09/2048	1 138	1 446	0,20
Canada Square Funding PLC			
5,682 % éch. 17/06/2058	1 168	1 477	0,20
Eurosail PLC			
5,940 % éch. 13/06/2045	465	585	0,08
Genesis Mortgage Funding PLC			
6,081 % éch. 15/09/2059	2 651	3 377	0,46
Mansard Mortgages PLC			
5,651 % éch. 15/12/2049	406	505	0,07
Newgate Funding PLC			
4,126 % éch. 15/12/2050	€ 424	446	0,06
Polaris PLC			
5,631 % éch. 23/12/2058	£ 1 135	1 436	0,19
Ripon Mortgages PLC			
5,491 % éch. 28/08/2056	5 584	7 074	0,97
Stratton Mortgage Funding PLC			
5,391 % éch. 20/07/2060	2 311	2 938	0,40
5,765 % éch. 12/03/2052	1 194	1 513	0,21
Towd Point Mortgage Funding PLC			
5,635 % éch. 20/10/2051	1 043	1 328	0,18
5,841 % éch. 20/07/2045	2 409	3 065	0,42
Trinity Square PLC			
5,316 % éch. 15/07/2059	1 083	1 375	0,19
		26 565	3,63
Total Royaume-Uni		53 422	7,31

ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Bon du Trésor britannique			
0,625 % éch. 22/10/2050	2 700	1 396	0,19
1,250 % éch. 31/07/2051	3 500	2 208	0,30
1,500 % éch. 31/07/2053	1 600	1 062	0,14
1,750 % éch. 22/01/2049	2 200	1 656	0,23
3,250 % éch. 22/01/2044	1 700	1 799	0,25
4,250 % éch. 07/12/2040	1 700	2 094	0,29
		10 215	1,40
Total Royaume-Uni		53 422	7,31

ÉTATS-UNIS			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS			
Amortizing Residential Collateral Trust			
5,850 % éch. 25/10/2031	\$ 2	2	0,00
Asset-Backed Funding Certificates Trust			
5,850 % éch. 25/06/2034	92	90	0,01
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
5,765 % éch. 25/02/2036	2 294	2 228	0,31
Citigroup Mortgage Loan Trust			
5,470 % éch. 25/12/2036	1 746	982	0,14
Countrywide Asset-Backed Certificates			
5,830 % éch. 25/12/2036 ^	10	7	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
5,290 % éch. 25/06/2037	\$ 1 229	\$ 1 134	0,16
5,290 % éch. 25/07/2037	353	321	0,04
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
4,599 % éch. 25/01/2032	1	1	0,00
Home Equity Mortgage Trust			
6,000 % éch. 25/01/2037 ^	261	238	0,03
IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
4,100 % éch. 25/03/2035	1 843	1 772	0,24
Long Beach Mortgage Loan Trust			
5,450 % éch. 25/05/2036	1 118	650	0,09
Massachusetts Educational Financing Authority			
6,205 % éch. 25/04/2038	81	81	0,01
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
5,390 % éch. 25/01/2036	2 075	1 849	0,25
5,470 % éch. 25/08/2036	5 084	1 870	0,26
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5,310 % éch. 25/09/2037	4	1	0,00
5,390 % éch. 25/02/2037	3 040	915	0,13
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
5,250 % éch. 25/11/2036	1 119	616	0,08
5,400 % éch. 25/07/2036	98	84	0,01
New Century Home Equity Loan Trust			
3,720 % éch. 20/06/2031	256	227	0,03
Option One Mortgage Loan Trust			
5,290 % éch. 25/01/2037	567	370	0,05
5,290 % éch. 25/02/2037	2 046	1 345	0,18
Residential Asset Securities Corp. Trust			
5,810 % éch. 25/11/2035	41	41	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5,270 % éch. 25/12/2036 ^	14	3	0,00
SLC Student Loan Trust			
6,271 % éch. 25/11/2042	354	352	0,05
Soundview Home Loan Trust			
5,555 % éch. 25/12/2036	2 793	2 713	0,37
5,650 % éch. 25/11/2036	2 119	1 967	0,27
5,855 % éch. 25/11/2035	230	223	0,03
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
6,670 % éch. 25/04/2035	27	27	0,00
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5,495 % éch. 25/01/2037	2 110	2 022	0,28
		22 131	3,03

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AbbVie, Inc.			
1,500 % éch. 15/11/2023	€ 100	108	0,01
American Tower Corp.			
2,950 % éch. 15/01/2025	\$ 1 400	1 340	0,18
3,800 % éch. 15/08/2029	800	731	0,10
Bank of America Corp.			
1,949 % éch. 27/10/2026	€ 1 000	1 027	0,14
3,384 % éch. 02/04/2026	\$ 600	575	0,08
Bayer U.S. Finance LLC			
6,562 % éch. 15/12/2023	900	899	0,12
Broadcom, Inc.			
2,450 % éch. 15/02/2031	600	488	0,07
Charter Communications Operating LLC			
3,500 % éch. 01/03/2042	1 000	670	0,09
5,125 % éch. 01/07/2049	700	551	0,08
6,384 % éch. 23/10/2035	800	780	0,11
Citigroup, Inc.			
3,290 % éch. 17/03/2026 (g)	2 200	2 105	0,29
Credit Suisse AG AT1			
Claim ^	1 400	56	0,01
Doctors Co. An Interinsurance Exchange			
4,500 % éch. 18/01/2032	200	159	0,02
Ford Motor Credit Co. LLC			
2,748 % éch. 14/06/2024	£ 600	730	0,10
2,900 % éch. 16/02/2028	\$ 100	86	0,01
3,375 % éch. 13/11/2025	800	745	0,10
4,687 % éch. 09/06/2025	600	579	0,08
GA Global Funding Trust			
2,250 % éch. 06/01/2027	600	532	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.			
4,281 % éch. 07/02/2025	€ 1 000	1 096	0,15

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET
Hyatt Hotels Corp. 1,300 % éch. 01/10/2023	\$ 500	\$ 495 0,07	CitiMortgage Alternative Loan Trust 5,750 % éch. 25/02/2037	\$ 1 882	\$ 1 572 0,22	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 5,282 % éch. 25/02/2034	\$ 11	\$ 10 0,00
JPMorgan Chase & Co. 2,595 % éch. 24/02/2026	1 800	1 708 0,23	Countrywide Alternative Loan Trust 3,940 % éch. 25/02/2037 ^	108	93 0,01	5,701 % éch. 25/04/2034	9	9 0,00
Lehman Brothers Holdings, Inc. 0,000 % éch. 16/11/2009 ^	700	2 0,00	5,250 % éch. 25/06/2035 ^	18	14 0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust 5,470 % éch. 25/01/2037	1 045	922 0,13
5,625 % éch. 24/01/2013 ^	600	1 0,00	5,337 % éch. 20/02/2047 ^	726	566 0,08	5,530 % éch. 25/07/2046 ^	327	236 0,03
6,200 % éch. 26/09/2014 ^	1 400	3 0,00	5,367 % éch. 20/07/2046 ^	178	143 0,02	5,570 % éch. 25/05/2036	129	87 0,01
7,875 % éch. 08/05/2018 ^	£ 1 800	11 0,00	5,476 % éch. 25/11/2035	55	48 0,01	5,590 % éch. 25/05/2036	630	506 0,07
Morgan Stanley 2,630 % éch. 18/02/2026	\$ 1 300	1 233 0,17	5,500 % éch. 25/05/2037 ^	66	21 0,00	5,726 % éch. 19/07/2034	6	5 0,00
Organon & Co. 4,125 % éch. 30/04/2028	400	355 0,05	6,000 % éch. 25/07/2037	1 992	1 028 0,14	5,846 % éch. 19/03/2034	2	2 0,00
Pacific Gas & Electric Co. 2,100 % éch. 01/08/2027	100	85 0,01	6,016 % éch. 25/11/2035	22	19 0,00	Structured Asset Securities Corp. 5,430 % éch. 25/01/2036	161	128 0,02
2,950 % éch. 01/03/2026 ^	100	92 0,01	6,026 % éch. 20/10/2035	1 135	825 0,11	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,440 % éch. 25/10/2036	457	383 0,05
3,150 % éch. 01/01/2026	100	93 0,01	6,250 % éch. 25/08/2037 ^	53	28 0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust 7,151 % éch. 25/06/2047 ^	86	76 0,01
3,450 % éch. 01/07/2025	100	94 0,01	6,500 % éch. 25/06/2036 ^	154	78 0,01	Wachovia Mortgage Loan Trust 1,560 % éch. 25/01/2037	1 423	547 0,08
3,950 % éch. 01/12/2047 ^	100	68 0,01	6,690 % éch. 25/11/2035	133	108 0,02	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,626 % éch. 25/09/2036	135	117 0,02
4,250 % éch. 15/03/2046 ^	300	214 0,03	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,810 % éch. 25/11/2034	5	4 0,00	3,753 % éch. 25/02/2037 ^	658	602 0,08
4,300 % éch. 15/03/2045 ^	100	72 0,01	5,610 % éch. 25/05/2035	20	17 0,00	3,823 % éch. 27/02/2034	6	6 0,00
4,550 % éch. 01/07/2030	200	181 0,03	5,790 % éch. 25/03/2035	93	80 0,01	3,824 % éch. 25/06/2037 ^	103	92 0,01
Penske Truck Leasing Co. LP 3,950 % éch. 10/03/2025	1 500	1 443 0,20	5,810 % éch. 25/02/2035	48	44 0,01	3,974 % éch. 25/05/2037 ^	387	343 0,05
Southern California Edison Co. 5,922 % éch. 01/04/2024	500	499 0,07	5,910 % éch. 25/09/2034	4	4 0,00	4,280 % éch. 25/03/2034	1	1 0,00
WEA Finance LLC 3,750 % éch. 17/09/2024	600	567 0,08	6,000 % éch. 25/02/2037	913	456 0,06	4,976 % éch. 25/02/2046	187	167 0,02
Wells Fargo & Co. 3,908 % éch. 25/04/2026	800	774 0,11	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 5,490 % éch. 25/06/2035	104	95 0,01	5,770 % éch. 25/01/2045	14	14 0,00
4,897 % éch. 25/07/2033	1 600	1 536 0,21	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust 5,390 % éch. 25/08/2036 ^	383	347 0,05	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,916 % éch. 25/07/2046 ^	78	49 0,01
		22 783 3,12	Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust 5,250 % éch. 25/10/2036 ^	4	3 0,00			19 419 2,66
			Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 5,677 % éch. 19/08/2045	48	41 0,01	AGENCES DU GOUVERNEMENT AMERICAIN		
			5,797 % éch. 19/07/2045 ^	3	0 0,00	Fannie Mae 2,944 % éch. 25/07/2039	331	298 0,04
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 4,715 % éch. 25/08/2035	13	10 0,00	3,000 % éch. 01/03/2060	787	696 0,10
CenturyLink, Inc. 7,467 % éch. 15/03/2027	818	633 0,09	Greenpoint Mortgage Funding Trust 5,690 % éch. 25/11/2045	9	8 0,00	3,500 % éch. 01/01/2059	1 691	1 544 0,21
OBLIGATIONS ET BILLETTS MUNICIPAUX			GSR Mortgage Loan Trust 6,780 % éch. 25/03/2033	4	4 0,00	3,621 % éch. 01/12/2034	9	9 0,00
Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021			HarborView Mortgage Loan Trust 4,826 % éch. 19/12/2036 ^	117	99 0,01	4,415 % éch. 01/11/2034	42	43 0,01
2,158 % éch. 01/06/2026	900	819 0,11	5,976 % éch. 19/10/2035	379	213 0,03	4,944 % éch. 01/09/2044	37	36 0,01
Obligations Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. Revenue Bonds, Series 2023			Impac CMB Trust 6,150 % éch. 25/07/2033	1	1 0,00	5,103 % éch. 25/03/2036	3	3 0,00
5,102 % éch. 01/04/2035	400	402 0,06	IndyMac Mortgage Loan Trust 3,327 % éch. 25/03/2036	474	325 0,05	5,258 % éch. 25/03/2034	3	3 0,00
		1 221 0,17	3,916 % éch. 25/12/2034	8	8 0,00	5,288 % éch. 25/08/2034	2	2 0,00
TITRES ADRESSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON EMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			JPMorgan Alternative Loan Trust 5,500 % éch. 25/11/2036 ^	2	1 0,00	5,550 % éch. 25/06/2036	17	17 0,00
Adjustable Rate Mortgage Trust 4,395 % éch. 25/09/2035 ^	11	9 0,00	5,630 % éch. 25/10/2036	253	226 0,03	5,650 % éch. 25/10/2040	37	36 0,00
American Home Mortgage Assets Trust 4,916 % éch. 25/10/2046	875	614 0,08	JPMorgan Mortgage Trust 3,655 % éch. 27/07/2037	168	152 0,02	6,000 % éch. 25/04/2043 - 25/07/2044	82	82 0,01
5,340 % éch. 25/05/2046 ^	187	157 0,02	3,854 % éch. 25/11/2033	5	4 0,00	Freddie Mac 0,000 % éch. 15/01/2038 (a)	282	12 0,00
Banc of America Funding Trust 3,896 % éch. 20/10/2046 ^	78	66 0,01	4,000 % éch. 25/02/2036 ^	92	69 0,01	4,021 % éch. 01/09/2035	1	1 0,00
4,416 % éch. 20/01/2047 ^	35	32 0,01	Madison Avenue Mortgage Trust 3,673 % éch. 10/09/2035	868	774 0,11	4,348 % éch. 15/01/2038	282	274 0,04
5,477 % éch. 20/02/2047	687	597 0,08	MASTR Alternative Loan Trust 5,550 % éch. 25/03/2036 ^	87	9 0,00	5,176 % éch. 25/10/2044 - 25/02/2045	171	159 0,02
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,887 % éch. 25/05/2047 ^	126	113 0,02	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 5,633 % éch. 15/12/2030	10	9 0,00	5,793 % éch. 15/12/2037 - 15/07/2040	124	123 0,02
4,096 % éch. 25/05/2034	11	9 0,00	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust 5,370 % éch. 25/03/2037	6 036	1 543 0,21	6,150 % éch. 25/05/2043	19	19 0,00
4,342 % éch. 25/08/2033	5	4 0,00	Residential Accredited Loans, Inc. Trust 4,165 % éch. 25/06/2046	792	193 0,03	Ginnie Mae 3,000 % éch. 20/07/2046 - 20/05/2047	23	21 0,00
4,403 % éch. 25/10/2033	6	6 0,00	5,091 % éch. 25/11/2037	713	595 0,08	Titre adressé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 2,500 % éch. 01/02/2051 - 01/01/2052	2 756	2 345 0,32
Bear Stearns ALT-A Trust 3,817 % éch. 25/11/2036 ^	374	198 0,03	5,300 % éch. 25/02/2047	164	62 0,01	3,000 % éch. 01/04/2043 - 01/06/2051	1 890	1 680 0,23
3,990 % éch. 25/11/2035 ^	101	79 0,01	5,450 % éch. 25/06/2037 ^	313	278 0,04	3,500 % éch. 01/10/2034 - 01/07/2050	1 470	1 368 0,19
4,202 % éch. 25/09/2035 ^	252	157 0,02	5,470 % éch. 25/03/2047	711	641 0,09	4,000 % éch. 01/06/2050	720	683 0,09
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust 3,484 % éch. 26/12/2046 ^	380	286 0,04	5,510 % éch. 25/07/2036 ^	1 094	458 0,06	Titre adressé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % éch. 01/08/2053	29 100	27 335 3,74
Chase Mortgage Finance Trust 4,529 % éch. 25/07/2037	42	32 0,00	5,950 % éch. 25/10/2045	64	54 0,01	4,500 % éch. 01/08/2053	42 300	40 691 5,57
Citigroup Mortgage Loan Trust 3,974 % éch. 25/09/2037 ^	232	204 0,03	6,000 % éch. 25/06/2036	365	291 0,04	5,000 % éch. 01/08/2053	21 700	21 268 2,91
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,014 % éch. 25/08/2035 ^	237	220 0,03	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 4,149 % éch. 25/09/2035 ^	38	24 0,00	5,500 % éch. 01/08/2053	29 100	28 957 3,96
6,780 % éch. 25/09/2035	16	15 0,00	6,500 % éch. 25/03/2032	0	0 0,00	6,000 % éch. 01/08/2053	58 200	58 705 8,04
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates 3,626 % éch. 25/09/2035 ^	300	260 0,04	Sequoia Mortgage Trust 3,723 % éch. 20/07/2037	449	363 0,05	6,500 % éch. 01/07/2053	58 300	59 526 8,15
			5,857 % éch. 20/07/2033	12	11 0,00			245 936 33,66
						OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMERICAIN		
						Obligations du Trésor américain 1,625 % éch. 15/11/2050	400	249 0,03

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	
4,000 % éch. 15/11/2052	\$ 200	\$205	0,03	Enel Finance America LLC					
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)				5,450 % éch. 06/07/2023	400	400	0,06		
0,125 % éch. 15/04/2025	5 578	5 307	0,73	5,450 % éch. 24/07/2023	400	398	0,05		
0,125 % éch. 15/07/2031	2 942	2 610	0,36	Global Payments, Inc.					
0,125 % éch. 15/01/2032	1 204	1 060	0,14	5,930 % éch. 28/07/2023	\$ 500	\$ 498	0,07		
0,250 % éch. 15/01/2025	6 019	5 770	0,79			5 221	0,72		
0,500 % éch. 15/01/2028	6 517	6 098	0,83	BONS DU TRÉSOR HONGROIS					
0,625 % éch. 15/07/2032	418	384	0,05	16,220 % éch. 06/07/2023 (b)(c) HUF	608 000	1 775	0,24		
1,125 % éch. 15/01/2033	5 397	5 174	0,71	BONS DU TRÉSOR ISRA�ËLIEN					
1,750 % éch. 15/01/2028	579	573	0,08	1,716 % éch. 05/07/2023 (b)(c) ILS	2 200	593	0,08		
2,375 % éch. 15/01/2027	752	756	0,10	BONS DU TRÉSOR JAPONAIS					
2,500 % éch. 15/01/2029	5 086	5 240	0,72	(0,202) % éch. 18/07/2023 (b)(c)	¥ 5 730 000	39 646	5,43		
3,875 % éch. 15/04/2029	1 661	1 835	0,25	(0,202) % éch. 28/08/2023 (b)(c)	377 000	2 609	0,36		
Billets du Trésor américain				(0,200) % éch. 24/07/2023 (b)(c)	3 250 000	22 488	3,08		
3,500 % éch. 15/02/2033	600	585	0,08	(0,200) % éch. 28/08/2023 (b)(c)	570 000	3 944	0,54		
		35 846	4,90	(0,197) % éch. 31/07/2023 (b)(c)	397 000	2 747	0,37		
Total États-Unis		347 969	47,63	(0,189) % éch. 28/08/2023 (b)(c)	343 000	2 374	0,32		
INSTRUMENTS À COURT TERME				(0,184) % éch. 04/09/2023 (b)(c)	6 390 000	44 219	6,06		
BILLETTS DE TRÉSORERIE				(0,183) % éch. 10/07/2023 (b)(c)	1 160 000	8 026	1,10		
AT+T, Inc.				(0,178) % éch. 31/07/2023 (b)(c)	¥ 113 000	\$ 782	0,11		
5,700 % éch. 19/03/2024	2 750	2 632	0,36	(0,173) % éch. 19/09/2023 (b)(c)	1 300 000	8 997	1,23		
Électricité de France S.A.				(0,172) % éch. 19/09/2023 (b)(c)	430 000	2 976	0,41		
5,510 % éch. 04/08/2023	1 300	1 293	0,18						
Total des Instruments à court terme				Total des Valeurs mobilières			\$ 880 157	120,47	
				ACTIONS					
				FONDS D'INVESTISSEMENT					
				ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF					
				PIMCO Select Funds plc -					
				Fonds PIMCO US Dollar					
				Short-Term Floating NAV					
				Fund (e)			4 454 619	44 360	6,07
				PIMCO Specialty Funds					
				Ireland p.l.c. - Fonds					
				PIMCO China Bond Fund					
				(e)			402 852	5 249	0,72
								49 609	6,79
				FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE					
				PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro					
				Short Maturity UCITS					
				ETF (e)			4 450	471	0,06
				Total des Fonds d'investissement			\$ 50 080	6,85	

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 1 874	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	\$ (1 911)	\$ 1 874	\$ 1 874	0,26
Total des contrats de mise en pension						\$ (1 911)	\$ 1 874	\$ 1 874	0,26

(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	171	\$ 446	0,06
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	73	26	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Long	06/2024	73	(16)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre	Court	09/2023	56	22	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Court	09/2023	62	25	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre	Long	09/2023	26	(6)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	378	728	0,10
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Long	09/2023	96	98	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	192	204	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	29	40	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Long	09/2023	15	33	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Court	09/2023	266	293	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	98	22	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Long	09/2023	32	130	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Court	09/2023	47	138	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	410	851	0,12
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	22	(23)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	79	107	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	3	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	9	(18)	0,00
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	117	150	0,02
				\$ 3 250	0,45

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	5	\$ (2)	\$ (2)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	5	(2)	0	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	98,000	15/12/2023	13	(11)	(1)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	13	(12)	(61)	(0,01)
				<u>\$ (27)</u>	<u>\$ (64)</u>	<u>(0,01)</u>

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 3 186 0,44

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 %	20/12/2024	\$ 100	\$ (1)	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20/06/2026	€ 500	(28)	0,00
				<u>\$ (29)</u>	<u>0,00</u>

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 à 10 ans	(1,000) %	20/06/2033	\$ 89 000	\$ (977)	(0,13)
Indice iTraxx Europe Main 39 à 10 ans	(1,000)	20/06/2033	€ 5 600	(78)	(0,01)
				<u>\$ (1 055)</u>	<u>(0,14)</u>

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-39 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	\$ 2 800	\$ 23	0,00
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	69 000	525	0,07
				<u>\$ 548</u>	<u>0,07</u>

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	3,250 %	20/09/2053	£ 2 100	\$ (195)	(0,03)
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	52 900	(2 643)	(0,36)
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	13 600	(868)	(0,12)
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	2 800	(103)	(0,01)
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	16/03/2032	INR 116 100	(102)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	15/03/2028	182 510	18	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2023	¥ 2 430 000	(24)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2026	970 000	24	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	(106)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	851 000	(10)	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	19/06/2039	540 000	335	0,05
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/12/2051	80 000	(74)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,450	15/12/2051	170 000	47	0,01
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	640 000	42	0,01
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,000	15/03/2028	SGD 5 920	(112)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	15/07/2023	\$ 24 600	333	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	25/08/2023	10 200	(142)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	31/08/2023	11 650	(162)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	15/09/2023	35 400	(494)	(0,07)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,400	15/01/2028	24 600	(2 812)	(0,39)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	16/06/2031	15 710	1 989	0,27
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	16 900	1 291	0,18
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	26 260	(1 886)	(0,26)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,249	31/08/2024	11 650	815	0,11
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2026	28 000	2 983	0,41
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2026	35 400	4 134	0,57
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,298	25/08/2024	10 200	729	0,10
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/12/2028	19 300	(2 561)	(0,35)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,518	20/01/2029	1 500	(185)	(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 ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630 %	20/01/2029	\$ 4 400	\$ (520)	(0,07)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,695	15/11/2031	30	(5)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	9 600	122	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	21 830	112	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	1 980	71	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	2 010	11	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,906	16/09/2052	2 300	(152)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,965	30/06/2024	15 900	(366)	(0,05)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,965	30/11/2026	27 900	1 404	0,19
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,968	30/06/2024	15 900	(366)	(0,05)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	3 400	67	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	2 890	(1)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,048	15/11/2032	10 200	479	0,07
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	500	(22)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,070	15/11/2032	4 000	179	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,083	15/11/2032	6 500	284	0,04
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,086	15/11/2032	4 700	157	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,089	15/11/2032	6 600	284	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	2 100	(84)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,106	15/11/2032	3 200	134	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,139	15/11/2032	4 500	176	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,150	13/05/2025	73 700	720	0,10
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,165	03/10/2053	1 000	3	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,173	15/11/2032	3 300	121	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,174	15/11/2032	3 500	127	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,200	13/05/2025	4 600	52	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,225	30/09/2029	2 800	(95)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,240	03/10/2053	1 000	17	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	4 800	77	0,01
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	20/12/2053	3 500	7	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,445	03/10/2038	3 200	1	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,454	30/06/2029	5 400	(96)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	1 100	(18)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/06/2030	1 800	(16)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2030	200	2	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2033	2 462	(19)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	700	(10)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,533	03/10/2038	3 200	(31)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	21/06/2025	14 800	239	0,03
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	20/12/2028	17 007	147	0,02
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,752	03/10/2028	4 100	(6)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	1 200	(10)	0,00
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,850	03/10/2028	4 100	11	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,898	30/06/2029	5 000	29	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,159	31/03/2025	35 100	568	0,08
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,250	20/12/2025	58 651	311	0,04
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,409	04/10/2024	15 000	(189)	(0,03)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,409	04/10/2024	15 000	196	0,03
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,789	07/03/2024	7 400	(60)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,789	07/03/2024	7 400	33	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,220	03/03/2025	CAD 6 900	(414)	(0,06)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2025	9 600	(508)	(0,07)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	9 200	(819)	(0,11)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	16/06/2051	250	(34)	(0,01)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,713	02/10/2029	2 100	(192)	(0,03)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,900	18/12/2029	24 500	(2 226)	(0,31)
À recevoir	Bon bancaire en CAD à 3 mois	3,250	15/03/2028	9 640	346	0,05
À recevoir	Bon bancaire en CAD à 3 mois	3,250	15/03/2033	4 900	178	0,02
À payer	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,250	21/06/2033	9 500	41	0,01
À payer ⁽⁴⁾	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,500	10/05/2025	101 700	(623)	(0,09)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,283	14/02/2027	CHF 900	(61)	(0,01)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,294	10/02/2027	8 500	(550)	(0,08)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,343	16/05/2027	1 900	(125)	(0,02)
À payer	CNREPOFIX CNY 3 mois	2,500	16/03/2027	CNY 61 000	123	0,02
À payer	CNREPOFIX CNY 3 mois	2,500	21/12/2027	90 900	216	0,03
À payer	CNREPOFIX CNY 3 mois	2,750	21/06/2028	64 900	32	0,00
À payer	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,000	23/11/2024	€ 17 300	(320)	(0,04)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2028	KRW 40 562 187	(577)	(0,08)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2033	3 184 165	7	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	20/09/2033	4 463 160	10	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	0,528	17/03/2024	NZD 650	(12)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,750	15/06/2027	9 400	(124)	(0,02)
À payer	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024	32 500	(284)	(0,04)
À payer ⁽⁴⁾	BBR NZD à 3 mois	4,750	20/03/2025	22 600	(78)	(0,01)
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	(257)	(0,04)
À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	15/03/2028	THB 108 160	36	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	15/07/2023	\$ 24 600	(330)	(0,05)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	25/08/2023	10 200	141	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	31/08/2023	11 650	163	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	15/09/2023	35 400	502	0,07

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 notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net	
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,750 %	16/09/2023	\$ 15 710	\$ 196	0,03	
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/09/2023	28 000	310	0,04	
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/09/2023	19 300	(201)	(0,03)	
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/07/2023	1 500	(9)	0,00	
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	20/07/2023	4 400	(23)	0,00	
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,409	04/07/2023	15 000	32	0,00	
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,409	04/07/2023	15 000	(32)	0,00	
À payer	LIBOR USD à 3 mois	4,789	07/07/2023	7 400	(2)	0,00	
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	4,789	07/09/2023	7 400	16	0,00	
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,250	17/06/2030	AUD 5 100	504	0,07	
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/03/2027	6 600	(397)	(0,05)	
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,000	21/06/2033	7 900	(219)	(0,03)	
À payer ⁽⁴⁾	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/09/2032	1 900	(8)	0,00	
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/03/2033	17 700	(448)	(0,06)	
À payer ⁽⁴⁾	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,500	15/09/2032	39 100	81	0,01	
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,913	30/01/2029	CZK 24 300	(164)	(0,02)	
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	0,054	27/05/2050	€ 450	116	0,02	
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,064	17/11/2052	1 000	356	0,05	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	900	(40)	(0,01)	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	2 400	(255)	(0,04)	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	1 800	(187)	(0,03)	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	1 400	(147)	(0,02)	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	2 200	(206)	(0,03)	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	1 300	(122)	(0,02)	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	11/04/2024	6 500	(102)	(0,01)	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	13/04/2024	14 700	(230)	(0,03)	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	17/05/2024	4 000	(68)	(0,01)	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	26/04/2024	1 600	(22)	0,00	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	2 200	(33)	0,00	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	2 100	(31)	0,00	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037	8 950	(827)	(0,11)	
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2042	1 260	(200)	(0,03)	
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	21 200	(153)	(0,02)	
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	19/03/2027	30 530	(203)	(0,03)	
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	121 700	(285)	(0,04)	
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	15/03/2033	13 460	(39)	(0,01)	
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	107 000	229	0,03	
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	38 200	(260)	(0,04)	
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,500	20/03/2024	HUF 342 600	(113)	(0,02)	
À payer	TIE MXN à 28 jours	4,870	07/07/2025	MXN 86 100	(247)	(0,03)	
						\$ (4 866)	(0,67)
Total des Instruments financiers dérivés compensés						\$ (5 402)	(0,74)

(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.

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 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,180 %	11/01/2024	3 600	\$ 103	\$ 369	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	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % éch. 25/05/2052	€ 97,000	23/05/2025	1 600	\$ 121	\$ 668	0,09

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 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	1 900	\$ (6)	\$ 0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	1 900	(6)	(26)	(0,01)
	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)	(762)	(0,11)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	600	(4)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	600	(4)	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,060	14/07/2023	400	(3)	(2)	0,00
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,360	14/07/2023	400	(3)	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	360	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	360	(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	1 600	(121)	(613)	(0,09)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	600	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	600	(4)	0	0,00
DUB	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	1 100	(7)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	1 100	(7)	(24)	0,00
GLM	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)	(4)	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)	(49)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	800	(5)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	800	(5)	(17)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	800	(5)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	800	(5)	(16)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	900	(6)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	900	(6)	(17)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	800	(5)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	800	(6)	(15)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	900	(6)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	900	(6)	(17)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	1 100	(8)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	1 100	(8)	(23)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	800	(5)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	800	(5)	(17)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	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	3,088	03/11/2023	500	(4)	(10)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	1 700	(11)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	1 700	(11)	(35)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	3 000	(11)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	3 000	(11)	(39)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	1 500	(5)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	1 500	(5)	(21)	0,00
Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	1 400	(4)	0	0,00	
Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	1 400	(4)	(18)	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)	(4)	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)	(62)	(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)	(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	900	(7)	(16)	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	(61)	(9)	0,00	
Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	400	(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	10/07/2023	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	3,250	20/07/2023	1 200	(4)	(2)	0,00	
Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	1 200	(4)	(5)	0,00	
Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	700	(5)	0	0,00	
Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	700	(5)	(15)	0,00	
Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	340	(1)	0	0,00	
Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	340	(1)	0	0,00	
							\$ (619)	\$ (1 843)	(0,25)

(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	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000 %	20/06/2025	\$ 1 500	\$ (37)	\$ 55	\$ 18	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	1 000	(24)	36	12	0,00
					\$ (61)	\$ 91	\$ 30	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.

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

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	\$ (17)	\$ 12	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)	11	9	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	7 000	4 830	(14)	12	(2)	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	(5)	4	0,00
						\$ 22	\$ 1	\$ 23	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 %	15/03/2028	MYR 33 519	\$ (13)	\$ 63	\$ 50	0,01
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2033	8 180	(2)	20	18	0,00
BPS	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	7 817	(3)	15	12	0,00
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,545	05/05/2028	8 126	0	10	10	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,635	05/04/2024	10 508	(3)	2	(1)	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2033	3 483	7	1	8	0,00
GST	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	17 760	(6)	32	26	0,01
SCX	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	4 750	(14)	10	(4)	0,00
						\$ (34)	\$ 153	\$ 119	0,02

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nombre 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 iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	S/O	1,084 %	\$ 5 400	20/09/2023	\$ 42	\$ (60)	\$ (18)	0,00
BPS	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	S/O	1,084	4 645	20/09/2023	36	(72)	(36)	(0,01)
	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid High Yield Index	S/O	1,084	14 200	20/03/2024	169	(279)	(110)	(0,01)
MYC	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid High Yield Index	S/O	1,084	1 700	20/03/2024	21	(21)	0	0,00
							\$ 268	\$ (432)	\$ (164)	(0,02)

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	07/2023	AUD	337	\$ 220	\$ 0	\$ (4)	0,00
	07/2023	\$	1 015	AUD 1 530	3	0	0,00
	08/2023	AUD	1 530	\$ 1 016	0	(3)	0,00
BOA	07/2023		2 708	1 768	0	(34)	0,00
	07/2023	CAD	8 047	5 914	0	(167)	(0,02)
	07/2023	DKK	29 635	4 279	0	(63)	(0,01)
	07/2023	NZD	1 606	974	0	(10)	0,00
	07/2023	\$	7 912	DKK 53 792	0	(30)	0,00
	07/2023		522	€ 478	0	(1)	0,00
	07/2023		1 789	£ 1 415	9	0	0,00
	07/2023		3 752	NOK 41 246	98	0	0,01
	07/2023		184	PEN 673	2	0	0,00
	08/2023	CNH	23 387	\$ 3 342	117	0	0,02
	08/2023	DKK	53 703	7 912	30	0	0,00
	08/2023	¥	828 579	6 009	229	0	0,03
	09/2023	CLP	502 008	614	0	(6)	0,00
	09/2023	IDR	136 167	9	0	0	0,00
	09/2023	¥	8 120 000	59 097	2 353	0	0,32
	09/2023	KRW	5 070 228	4 002	138	0	0,02
	09/2023	TWD	83 288	2 744	64	0	0,01
	09/2023	\$	1 667	INR 137 917	9	0	0,00
	09/2023		455	PEN 1 669	3	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
BPS	07/2023	CAD	877	\$ 656	\$ 0	\$ (7)	0,00
	07/2023	DKK	105	15	0	0	0,00
	07/2023	€	1 215	1 331	5	0	0,00
	07/2023	ILS	1 057	332	47	0	0,01
	07/2023	¥	2 102 167	15 131	586	0	0,08
	07/2023	MYR	7 458	1 625	24	0	0,00
	07/2023	NOK	9 647	897	0	(3)	0,00
	07/2023	\$	724	AUD 1 094	4	0	0,00
	07/2023		130 741	€ 119 313	1	(571)	(0,08)
	08/2023	AUD	1 094	\$ 725	0	(4)	0,00
	08/2023	CNH	102 230	14 670	570	0	0,08
	08/2023	€	115 147	126 344	546	0	0,07
	08/2023	TWD	41 688	1 365	27	0	0,00
	08/2023	\$	897	NOK 9 637	3	0	0,00
	09/2023	THB	4	\$ 0	0	0	0,00
BRC	07/2023	£	523	649	0	(16)	0,00
	07/2023	¥	5 730 000	44 301	4 580	0	0,63
	07/2023	\$	792	£ 640	22	0	0,00
	09/2023	IDR	41 220	\$ 3	0	0	0,00
	09/2023	ILS	2 793	781	26	0	0,00
	09/2023	\$	145	PEN 532	1	0	0,00
	04/2024	¥	690 018	\$ 5 644	656	0	0,09
	05/2024		310 000	2 507	256	0	0,03
BSH	07/2023	\$	572	PEN 2 107	8	0	0,00
CBK	07/2023	AUD	1 169	\$ 763	0	(15)	0,00
	07/2023	ILS	6 406	1 894	167	0	0,02
	07/2023	NZD	1 289	791	1	0	0,00
	07/2023	\$	630	CLP 509 551	5	0	0,00
	07/2023		2 121	€ 1 969	28	(1)	0,00
	07/2023		1 112	£ 875	0	0	0,00
	07/2023		160	NOK 1 796	8	0	0,00
	07/2023		833	PEN 3 052	8	0	0,00
	08/2023	¥	461 421	\$ 3 348	129	0	0,02
	08/2023	TWD	43 402	1 422	28	0	0,00
	08/2023	\$	217	CNH 1 496	0	(11)	0,00
	09/2023	CNH	15 978	\$ 2 242	32	0	0,00
	09/2023	\$	39	KRW 49 702	0	(1)	0,00
	09/2023		2 363	THB 81 767	3	(42)	(0,01)
	10/2023		2	CLP 1 914	0	0	0,00
	11/2023	ILS	10 830	\$ 3 236	298	0	0,04
CLY	07/2023	DKK	87 094	12 571	0	(190)	(0,03)
	08/2023	CNH	4 097	578	13	0	0,00
DUB	07/2023	ILS	7 554	2 157	120	0	0,02
	07/2023	\$	3 613	BRL 19 578	445	0	0,06
	09/2023		167	PEN 612	1	0	0,00
GLM	07/2023	BRL	17 840	\$ 3 695	0	(3)	0,00
	07/2023	NOK	59 496	5 520	0	(33)	0,00
	07/2023	PEN	3 826	1 048	0	(7)	0,00
	08/2023	CNH	13 283	1 903	70	0	0,01
	08/2023	\$	5 520	NOK 59 438	34	0	0,00
	08/2023		472	PEN 1 722	1	0	0,00
	09/2023		3 695	BRL 18 038	3	0	0,00
	09/2023		576	PEN 2 119	5	0	0,00
	09/2023		3 364	SGD 4 498	0	(31)	0,00
	09/2023		1	THB 34	0	0	0,00
JPM	07/2023	AUD	2 602	\$ 1 701	0	(31)	0,00
	07/2023	KRW	11 031 641	8 641	262	0	0,04
	07/2023	SGD	1 107	838	20	0	0,00
	07/2023	\$	4 758	¥ 680 400	0	(50)	(0,01)
	08/2023	CNH	53 553	\$ 7 745	359	0	0,05
	08/2023	¥	677 508	4 758	50	0	0,01
	08/2023	\$	84	HUF 28 991	0	0	0,00
	09/2023	IDR	56 949	\$ 4	0	0	0,00
	09/2023	ILS	2 680	754	30	0	0,00
	09/2023	PEN	13 317	3 617	0	(35)	0,00
	09/2023	\$	1	IDR 12 251	0	0	0,00
	09/2023		198	INR 16 355	0	0	0,00
	09/2023		746	THB 25 578	0	(19)	0,00
	12/2023		3 625	INR 299 140	0	(1)	0,00
	10/2024	¥	330 000	\$ 2 646	199	0	0,03
MBC	07/2023	€	1 805	1 939	0	(30)	0,00
	07/2023	£	34 946	43 387	23	(1 065)	(0,14)
	07/2023	¥	3 250 000	24 885	2 336	0	0,32
	07/2023	SGD	63	47	0	0	0,00
	07/2023	\$	3 027	CAD 4 013	10	(5)	0,00
	07/2023		1 574	€ 1 467	26	0	0,00
	07/2023		2 461	£ 1 975	50	0	0,01
	07/2023		735	¥ 104 200	0	(14)	0,00
	08/2023		13 635	\$ 440	2	0	0,00
	09/2023	KRW	9 398 733	7 370	207	0	0,03
	03/2024	¥	620 016	5 070	610	0	0,08
	10/2024		730 000	5 853	439	0	0,06

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		
MYI	07/2023	£	920	\$ 1 143	\$ 0	\$ (26)	0,00		
	07/2023	IDR	35 891	2	0	0	0,00		
	07/2023	NZD	107	65	0	(1)	(1)	0,00	
	07/2023	\$	1 415	AUD 2 114	0	(8)	(8)	0,00	
	07/2023		7 033	DKK 47 973	0	(4)	(4)	0,00	
	07/2023		2	IDR 35 891	0	0	0	0,00	
	08/2023	DKK	47 893	\$ 7 033	4	0	4	0,00	
	08/2023	TWD	56 185	1 851	46	0	46	0,01	
	09/2023	IDR	35 922	2	0	0	0	0,00	
	09/2023	KRW	10 562 658	8 254	204	0	204	0,03	
	09/2023	\$	849	IDR 12 681 287	0	(7)	(7)	0,00	
	09/2023		43	INR 3 533	0	0	0	0,00	
	09/2023		341	THB 11 659	0	(9)	(9)	0,00	
	10/2024	¥	260 000	\$ 2 126	198	0	198	0,03	
	RBC	07/2023	\$	783	CAD 1 050	10	0	10	0,00
07/2023			61	MXN 1 172	7	0	7	0,00	
08/2023		MXN	2 340	\$ 135	0	0	0	0,00	
RYL	04/2024	DKK	7 300	1 096	8	0	8	0,00	
	07/2023	AUD	3 672	2 400	0	(45)	(45)	(0,01)	
SCX	07/2023		7 459	MYR 1 623	22	0	22	0,00	
	07/2023		4 183	NZD 2 540	0	(23)	(23)	0,00	
	07/2023	\$	1 492	AUD 2 247	4	0	4	0,00	
	08/2023	AUD	2 247	\$ 1 493	0	(4)	(4)	0,00	
	08/2023	CNH	120 329	17 518	923	0	923	0,13	
	08/2023	TWD	8 929	292	6	0	6	0,00	
	09/2023	CNH	3 589	503	7	0	7	0,00	
	09/2023	TWD	69 614	2 283	43	0	43	0,01	
	09/2023	\$	1 845	IDR 27 573 000	0	(13)	(13)	0,00	
	09/2023		124	INR 10 229	0	0	0	0,00	
	09/2023		1 523	KRW 1 940 075	0	(44)	(44)	(0,01)	
	09/2023		308	PEN 1 138	4	0	4	0,00	
	09/2023		1 586	THB 54 723	0	(31)	(31)	0,00	
	SOG	07/2023	AUD	2 223	\$ 1 455	0	(25)	(25)	0,00
		07/2023	€	120 207	129 311	0	(1 835)	(1 835)	(0,25)
SSB	07/2023	CLP	510 282	635	0	0	0	0,00	
	07/2023	¥	510 000	3 867	325	0	325	0,04	
	08/2023	\$	635	CLP 511 755	0	0	0	0,00	
TOR	09/2023	KRW	4 702 968	\$ 3 626	42	0	42	0,01	
	07/2023	AUD	1 176	769	0	(14)	(14)	0,00	
	07/2023	\$	1 826	AUD 2 765	14	0	14	0,00	
	07/2023		2 918	CAD 3 862	2	(2)	0	0,00	
	07/2023		40 007	£ 31 484	20	0	20	0,00	
	07/2023		9 149	¥ 1 317 476	0	(34)	(34)	0,00	
	07/2023		4 376	NZD 7 185	26	0	26	0,00	
	08/2023	AUD	2 765	\$ 1 828	0	(14)	(14)	0,00	
	08/2023	CAD	3 860	2 918	2	(2)	0	0,00	
	08/2023	£	31 484	40 015	0	(20)	(20)	0,00	
	08/2023	¥	1 311 888	9 149	34	0	34	0,00	
	08/2023	NZD	7 185	4 375	0	(26)	(26)	0,00	
	07/2023	AUD	269	176	0	(3)	(3)	0,00	
	07/2023	BRL	1 794	364	0	(8)	(8)	0,00	
	07/2023	¥	1 160 000	8 849	817	0	817	0,11	
07/2023	\$	2 943	AUD 4 407	6	(15)	(9)	0,00		
07/2023		2 607	NOK 28 851	86	0	86	0,01		
08/2023	AUD	4 407	\$ 2 945	15	(6)	9	0,00		
09/2023	CNH	4 818	THB 23 334	0	(3)	(3)	0,00		
09/2023	ILS	2 319	\$ 648	21	0	21	0,00		
09/2023	SGD	4 075	3 049	29	0	29	0,00		
09/2023	\$	1 578	INR 130 474	8	0	8	0,00		
				\$ 19 372	\$ (4 725)	\$ 14 647	2,01		

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	€	1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
	07/2023	\$	7 823	€ 7 279	118	0	118	0,02
BPS	07/2023	€	7 560	\$ 8 284	36	0	36	0,00
	07/2023	\$	7 938	€ 7 382	116	0	116	0,02
CBK	08/2023		8 295	7 560	0	(36)	(36)	(0,01)
	07/2023	€	7 476	\$ 8 128	0	(28)	(28)	0,00
	07/2023	\$	589	€ 545	6	0	6	0,00
JPM	08/2023		8 140	7 476	28	0	28	0,00
	07/2023	€	7 559	\$ 8 254	7	0	7	0,00
MBC	08/2023	\$	8 265	€ 7 559	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	€	15	\$ 16	0	0	0	0,00
SOG	07/2023	\$	148	€ 139	3	0	3	0,00
	07/2023		7 817	7 266	111	0	111	0,02
				\$ 425	\$ (71)	\$ 354	0,05	

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	\$	289	192	\$ 0	(1) 0,00	
	07/2023	\$	AUD	105	161	\$ 2	0 0,00	
	08/2023			192	289	\$ 1	0 0,00	
BOA	07/2023	CLP	\$	38 151	47	0	0 0,00	
	07/2023	DKK		706	104	0	0 0,00	
	07/2023	PEN		278	77	0	0 0,00	
	07/2023	SEK		4 274	396	0	0 0,00	
	07/2023	THB		12 906	363	0	(1) 0,00	
	07/2023	\$	AUD	419	643	9	0 0,00	
	07/2023		CAD	2 908	3 957	82	0 82 0,01	
	07/2023		CLP	47	38 151	1	0 1 0,00	
	07/2023		DKK	221	1 528	3	0 3 0,00	
	07/2023		€	4 250	3 955	64	0 64 0,01	
	07/2023		HUF	117	40 985	2	0 2 0,00	
	07/2023		¥	60	8 358	0	(2) (2) 0,00	
	07/2023		KRW	4	5 019	0	0 0 0,00	
	07/2023		NOK	57	631	1	0 1 0,00	
	07/2023		NZD	51	84	1	0 1 0,00	
	07/2023		PEN	75	278	2	0 2 0,00	
	07/2023		SEK	3	29	0	0 0 0,00	
	BPS	08/2023	CNY	\$	725	100	0	0 0 0,00
		08/2023	\$	CLP	47	38 151	0	0 0 0,00
		08/2023		DKK	104	705	0	0 0 0,00
08/2023			PEN	76	278	0	0 0 0,00	
08/2023			SEK	396	4 269	0	0 0 0,00	
08/2023			THB	364	12 906	1	0 1 0,00	
07/2023		AUD	\$	96	63	0	(1) (1) 0,00	
07/2023		CHF		489	547	0	0 0 0,00	
07/2023		CNY		66 515	9 207	42	0 42 0,01	
07/2023		€		17 592	19 276	84	0 84 0,01	
07/2023		NOK		154	14	0	0 0 0,00	
07/2023		TWD		475	16	0	0 0 0,00	
07/2023		\$	CHF	3	2	0	0 0 0,00	
07/2023			CZK	161	3 542	2	0 2 0,00	
07/2023			€	18 791	17 479	281	0 281 0,04	
07/2023			¥	12 304	1 710 247	0	(472) (472) 0,07	
07/2023			NZD	5	8	0	0 0 0,00	
08/2023			CHF	547	488	0	0 0 0,00	
08/2023			CNY	9 207	66 421	0	(24) (24) 0,00	
08/2023			€	19 259	17 552	0	(84) (84) 0,01	
08/2023		NOK	14	154	0	0 0 0,00		
BRC	07/2023	KRW	\$	1 517 793	1 150	0	(2) (2) 0,00	
	07/2023	\$	PLN	196	827	8	0 8 0,00	
	08/2023		KRW	1 150	1 515 884	2	0 2 0,00	
CBK	07/2023	€	\$	3 842	4 174	0	(18) (18) 0,00	
	07/2023	ILS		403	111	2	0 2 0,00	
	07/2023	MXN		5 932	345	0	(1) (1) 0,00	
	07/2023	\$	AUD	182	278	4	0 4 0,00	
	07/2023		CNY	185	1 316	0	(4) (4) 0,00	
	07/2023		MXN	330	5 932	16	0 16 0,00	
	07/2023		NOK	5	56	0	0 0 0,00	
	07/2023		TWD	15	476	0	0 0 0,00	
	08/2023	TWD	\$	476	15	0	0 0 0,00	
	08/2023	\$	€	3 915	3 596	14	0 14 0,00	
GLM	08/2023		ILS	111	402	0	(3) (3) 0,00	
	08/2023		MXN	343	5 932	1	0 1 0,00	
	07/2023	NOK	\$	950	88	0	(1) (1) 0,00	
	07/2023	\$	MYR	412	1 847	0	(16) (16) 0,00	
MBC	07/2023		THB	374	12 906	0	(10) (10) 0,00	
	08/2023		NOK	88	950	1	0 1 0,00	
	07/2023	£	\$	121	151	0	(3) (3) 0,00	
	07/2023	\$	CAD	2	2	0	0 0 0,00	
	07/2023		CNY	64	456	0	(1) (1) 0,00	
	07/2023		£	4 201	3 394	115	0 115 0,01	
MYI	07/2023		SEK	5	54	0	0 0 0,00	
	07/2023		SGD	246	332	0	0 0 0,00	
	07/2023	CZK	\$	3 547	163	1	0 1 0,00	
	07/2023	DKK		630	92	0	0 0 0,00	
	07/2023	IDR	7 012 427	465	0	(2) (2) 0,00		
	07/2023	MYR		1 847	398	2	0 2 0,00	
	07/2023	PLN		827	204	1	0 1 0,00	
	07/2023	SGD		344	255	0	0 0 0,00	
	07/2023	\$	CHF	4	4	0	0 0 0,00	
	07/2023		DKK	1	5	0	0 0 0,00	
	07/2023		ILS	108	402	0	0 0 0,00	
	07/2023		SEK	390	4 186	0	(2) (2) 0,00	
	08/2023		CZK	163	3 551	0	(1) (1) 0,00	
	08/2023		DKK	92	629	0	0 0 0,00	
	08/2023		IDR	465	7 015 079	1	0 1 0,00	
	08/2023		MYR	399	1 847	0	(2) (2) 0,00	
	08/2023		PLN	204	829	0	(1) (1) 0,00	
	08/2023		SGD	255	344	0	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	
RBC	07/2023	CNY	280	\$ 39	\$ 1	\$ 1	0,00	
SCX	07/2023	AUD	425	282	0	(1)	0,00	
	07/2023	IDR	9 895	1	0	0	0,00	
	07/2023	\$	390	AUD 597	7	0	0,00	
	07/2023		530	CHF 476	2	0	0,00	
	07/2023		133	NZD 220	1	0	0,00	
	08/2023		282	AUD 425	1	0	0,00	
TOR	07/2023	AUD	522	\$ 345	0	(3)	0,00	
	07/2023	CAD	2 806	2 114	0	(6)	0,00	
	07/2023	£	3 272	4 158	0	(2)	0,00	
	07/2023	HUF	41 067	122	1	0	0,00	
	07/2023	NZD	312	190	0	(1)	0,00	
	07/2023	\$	368	AUD 563	7	0	0,00	
	08/2023		345	522	3	0	0,00	
	08/2023		2 114	CAD 2 806	6	0	0,00	
	08/2023		4 159	£ 3 272	2	0	0,00	
	08/2023		122	HUF 41 377	0	(1)	0,00	
	08/2023		190	NZD 312	1	0	0,00	
UAG	07/2023	AUD	1 039	\$ 693	3	(2)	0,00	
	07/2023	CHF	24	27	0	0	0,00	
	07/2023	\$	84	AUD 129	1	0	0,00	
	07/2023		35	CHF 31	0	0	0,00	
	07/2023		9 275	CNY 65 202	0	(292)	(0,04)	
	07/2023		0	CZK 5	0	0	0,00	
	07/2023		465	IDR 6 985 798	0	0	0,00	
	07/2023		1 145	KRW 1 510 095	1	0	0,00	
	07/2023		42	NOK 461	1	0	0,00	
	07/2023		22	SGD 29	0	0	0,00	
	08/2023		693	AUD 1 039	2	(3)	0,00	
	08/2023		27	CHF 24	0	0	0,00	
					\$ 786	\$ (963)	\$ (177)	(0,03)
Total des Instruments financiers dérivés hors cote							\$ 14 026	1,92

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. 01/07/2038	\$ 13 300	\$ (11 787)	(1,61)
2,000 % éch. 01/08/2053	75 650	(61 800)	(8,46)
2,500 % éch. 01/07/2053	3 300	(2 799)	(0,38)
3,000 % éch. 01/08/2053	2 700	(2 380)	(0,33)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (78 766)	(10,78)
Total des Investissements		\$ 865 155	118,42
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (134 579)	(18,42)
Actifs nets		\$ 730 576	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) Titre convertible conditionnel.
- (g) 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	\$ 2 105	0,29
Deutsche Bank AG	3,729	14/01/2032	22/01/2021	301	227	0,03
				\$ 2 501	\$ 2 332	0,32

Un montant en numéraire de 25 310 \$ (31 décembre 2022 : 25 647 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 1 610 \$ (31 décembre 2022 : 12 800 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivait les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 880 107	\$ 50	\$ 880 157
Fonds d'investissement	50 080	0	0	50 080
Contrats de mise en pension	0	1 874	0	1 874
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	1 739	10 071	0	11 810
Titres vendus à découvert	0	(78 766)	0	(78 766)
Totaux	\$ 51 819	\$ 813 286	\$ 50	\$ 865 155

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 10	\$ 20	\$ 30	\$ 27	\$ 0	\$ 27
BOA	2 647	(2 280)	367	(4 371)	3 760	(611)
BOM	S/O	S/O	S/O	(9)	0	(9)
BPS	1 093	(1 080)	13	633	(530)	103
BRC	5 551	(5 420)	131	488	(400)	88
BSH	8	0	8	S/O	S/O	S/O
CBK	675	(550)	125	979	(680)	299
CLY	(177)	0	(177)	(11)	0	(11)
DUB	489	(440)	49	(252)	280	28
GLM	(300)	290	(10)	(593)	420	(173)
GST	26	0	26	(35)	0	(35)
HUS	S/O	S/O	S/O	(5)	0	(5)
IND	S/O	S/O	S/O	193	(330)	(137)
JPM	768	(720)	48	165	0	165
MBC	2 703	(2 850)	(147)	(4 349)	3 720	(629)
MYC	(11)	10	(1)	15	10	25
MYI	394	(270)	124	(894)	490	(404)
RBC	18	0	18	(1)	0	(1)
RYL	8	(10)	(2)	(3)	0	(3)
SCX	855	(840)	15	(688)	600	(88)
SOG	(1 749)	1 290	(459)	S/O	S/O	S/O
SSB	367	(290)	77	S/O	S/O	S/O
TOR	(7)	0	(7)	(3 747)	3 130	(617)
UAG	658	(670)	(12)	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	73,15	51,35
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	47,31	51,26
Autres valeurs mobilières	0,01	0,37
Fonds d'investissement	6,85	6,61
Contrats de mise en pension	0,26	0,23
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,44	0,23
Instruments financiers dérivés compensés	(0,74)	(2,33)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,92	(1,82)
Titres vendus à découvert	(10,78)	(10,64)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	1,78	1,91
Belgique	0,11	S/O
Brésil	S/O	0,21
Canada	1,25	1,68
Îles Caïmans	3,01	2,86
Chine	4,20	2,16
Danemark	2,44	2,57
France	2,82	3,25
Allemagne	2,15	2,47
Hong Kong	S/O	0,08
Hongrie	0,17	0,03
Irlande	6,31	6,51
Israël	1,21	1,22
Italie	1,20	1,29
Japon	7,06	4,87
Luxembourg	0,73	0,71
Malaisie	0,62	0,92
Mexique	0,04	0,04
Multinationales	0,11	0,11
Pays-Bas	0,51	0,77
Nouvelle-Zélande	0,09	0,09
Norvège	0,21	0,22
Pérou	0,09	1,21
Pologne	0,31	0,03
Portugal	0,16	0,14
Qatar	0,05	0,05
Roumanie	0,85	0,55
Arabie saoudite	0,61	S/O
Serbie	0,15	0,26
Singapour	0,08	S/O
Slovénie	0,23	0,22
Corée du Sud	3,93	2,27
Espagne	1,11	1,50
Supranationales	0,50	0,51
Suède	0,09	0,09
Suisse	1,23	0,95
Thaïlande	S/O	0,51
Émirats arabes unis	0,07	0,07
Royaume-Uni	7,31	9,28
États-Unis	47,63	30,13
Instruments à court terme	20,05	21,24
Fonds d'investissement	6,85	6,61
Contrats de mise en pension	0,26	0,23
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,45	0,24
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	(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	0,07	S/O
Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base	S/O	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(0,67)	(2,19)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,05	0,05
Options sur titres	0,09	0,09
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,25)	(0,28)
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 sur devises croisées	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,02	(0,02)
Swaps de rendement total sur indices	(0,02)	0,07
Contrats de change à terme	2,01	(2,07)
Contrats de change à terme couverts	0,02	0,35
Titres vendus à découvert	(10,78)	(10,64)
Autres actifs et passifs à court terme	(18,42)	4,74
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (suite)

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	DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET			
Residential Asset Mortgage Products Trust 5,500 % éch. 25/10/2036	\$ 534	\$ 500	0,08	ACTIONS ORDINAIRES SERVICES FINANCIERS				INSTRUMENTS À COURT TERME BONS DU TRÉSOR ARGENTIN						
Residential Asset Securities Corp. Trust 5,400 % éch. 25/11/2036 A	2 983	2 582	0,39	Bank of America Corp.	95 800	\$ 2 749	0,41	(28,578) % éch.	ARS	38 226	\$ 75	0,01		
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,500 % éch. 25/05/2037	127	93	0,01	Citigroup, Inc.	61 100	2 813	0,42	18/10/2023 (c)(d)						
5,930 % éch. 25/02/2034	282	274	0,04	JPMorgan Chase & Co.	21 000	3 054	0,46	(12,549) % éch.						
Segovia European CLO DAC 4,080 % éch. 20/07/2032	€ 700	744	0,11	Wells Fargo & Co.	71 700	3 060	0,46	23/11/2023 (c)(d)		75 134	152	0,02		
Sound Point CLO Ltd. 6,412 % éch. 18/04/2031	\$ 800	786	0,12			11 676	1,75					227	0,03	
Structured Asset Investment Loan Trust 5,770 % éch. 25/01/2036	436	402	0,06	TITRES PRIVILÉGIÉS				BONS DU TRÉSOR JAPONAIS						
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,720 % éch. 25/10/2036	188	182	0,03	Nationwide Building Society 10,250 %	1 490	218	0,03	(0,202) % éch.	¥	8 387 000	58 031	8,68		
5,945 % éch. 25/02/2036	200	189	0,03	SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER				(0,199) % éch.		2 060 000	14 256	2,13		
6,155 % éch. 25/11/2035	1 000	983	0,15	Agree Realty Corp.	41 327	2 702	0,40	(0,184) % éch.		9 458 000	65 452	9,79		
Toro European CLO DAC 3,995 % éch. 12/01/2032	€ 300	321	0,05	American Tower Corp.	9 856	1 912	0,29	(0,179) % éch.		460 000	3 183	0,48		
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust 5,460 % éch. 25/08/2036	\$ 500	468	0,07	Apartment Income REIT Corp.	62 213	2 245	0,34						140 922	21,08
		55 987	8,37	Equinix, Inc.	2 871	2 251	0,34	Total des Instruments à court terme					141 149	21,11
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Equity LifeStyle Properties, Inc.	30 425	2 035	0,30	Total des Valeurs mobilières		\$ 524 174	78,41			
Obligation internationale du gouvernement argentin 0,500 % éch. 09/07/2030	994	273	0,04	Equity Residential	39 817	2 627	0,39	ACTIONS						
1,500 % éch. 09/07/2035	653	188	0,03	First Industrial Realty Trust, Inc.	62 470	3 288	0,49	FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF						
Obligation internationale du gouvernement chinois 3,280 % éch. 03/12/2027	CNY 139 660	19 987	2,99	Gaming and Leisure Properties, Inc.	48 445	2 348	0,35	PIMCO Funds: Global						
TES colombien 7,750 % éch. 18/09/2030	COP 25 722 500	5 490	0,82	Host Hotels & Resorts, Inc.	135 801	2 286	0,34	Investors Series plc - Fonds PIMCO Capital Securities Fund (g)	725 222	7 586	1,13			
Obligation internationale du gouvernement japonais 1,700 % éch. 20/09/2044	¥ 600 000	4 668	0,70	Invitation Homes, Inc.	104 896	3 608	0,54	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	13 273 152	132 173	19,77			
Obligation internationale du gouvernement péruvien 1,862 % éch. 01/12/2032	\$ 1 800	1 390	0,21	Life Storage, Inc.	10 431	1 387	0,21						139 759	20,90
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 71 750	3 944	0,59	National Storage Affiliates Trust	25 381	884	0,13	FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE						
Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,700 % éch. 30/04/2032	€ 5 000	4 382	0,65	Prologis, Inc.	42 264	5 183	0,78	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	978 412	97 186	14,54			
Bon du Trésor britannique 0,625 % éch. 22/10/2050	£ 3 000	1 551	0,23	Public Storage	4 700	1 372	0,21	Total des Fonds d'investissement		\$ 236 945	35,44			
		41 873	6,26	RLJ Lodging Trust	138 744	1 425	0,21							
				SBA Communications Corp.	9 092	2 107	0,32							
				Simon Property Group, Inc.	22 810	2 634	0,39							
				Sun Communities, Inc.	13 938	1 818	0,27							
				Sunstone Hotel Investors, Inc.	56 900	576	0,09							
				VICI Properties, Inc.	77 162	2 425	0,36							
						45 113	6,75							

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 18 513	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	\$ (18 883)	\$ 18 513	\$ 18 514	2,77
Total des Contrats de mise en pension						\$ (18 883)	\$ 18 513	\$ 18 514	2,77

(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 billet du gouvernement australien à 3 ans septembre	Long	09/2023	74	\$ (30)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Long	09/2023	15	(6)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice CAC 40 Index juillet	Long	07/2023	29	36	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre	Long	09/2023	41	(55)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Indice DAX Index septembre	Long	09/2023	3	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index septembre	Long	09/2023	1 151	6 994	1,04
Contrats à terme standardisés sur Euro STOXX 50 septembre	Court	09/2023	91	(84)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro STOXX 600 septembre	Long	09/2023	2 665	169	0,02
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Long	09/2023	36	(62)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Long	09/2023	46	47	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	147	209	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Long	09/2023	2	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Court	09/2023	33	25	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 FTSE 100 Index septembre	Court	09/2023	6	\$ (3)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/MIB Index septembre	Long	09/2023	10	48	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice IBEX 35 Index juillet	Long	07/2023	1	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Long	09/2023	23	95	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice Mini MSCI Emerging Markets Index septembre	Long	09/2023	6	(3)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Nikkei 225 libellés en yen septembre	Long	09/2023	60	290	0,04
Contrats à terme standardisés sur Indice OMXS30 Index juillet	Long	07/2023	6	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur S&P/Toronto Stock Exchange 60 septembre	Long	09/2023	67	198	0,03
Contrats à terme standardisés sur Indice SPI 200 Index septembre	Long	09/2023	67	61	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice Topix Index septembre	Long	09/2023	117	639	0,09
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	29	(85)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	347	(691)	(0,10)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	164	308	0,05
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	408	468	0,07
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	128	35	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	42	(83)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Long	09/2023	10	(11)	0,00
				\$ 8 518	1,27

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	\$ 123,000	21/07/2023	29	\$ (11)	\$ (4)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	131,000	21/07/2023	29	(15)	(6)	0,00
				\$ (26)	\$ (10)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 8 508 1,27

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 ⁽³⁾	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2026	\$ 100	\$ (1)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	100	1	0,00
				\$ 0	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 à 5 ans	(1,000) %	20/06/2028	\$ 12 600	\$ (82)	(0,01)
Indice iTraxx Crossover 37 à 5 ans	(5,000)	20/06/2027	€ 100	0	0,00
				\$ (82)	(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.HY-40 à 5 ans	5,000 %	20/06/2028	\$ 600	\$ 20	0,00
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	5 500	104	0,02
Indice iTraxx Europe Main 39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	€ 200	2	0,00
				\$ 126	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	3,250 %	20/09/2053	£ 1 500	\$ 134	0,02
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	4 300	(311)	(0,05)
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	1 900	(121)	(0,02)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,260	15/09/2026	INR 38 400	1	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/09/2027	157 780	(11)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2026	¥ 1 090 000	15	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	690 000	(55)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,450	15/12/2051	300 000	(154)	(0,02)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	1,000	15/03/2053	520 000	253	0,04

Tableau des investissements Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation 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	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250 %	15/12/2026	SGD 7 140	\$ (74)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,250	16/03/2024	\$ 14 500	(16)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	800	14	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	14 300	438	0,07
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	4 000	(127)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	3 100	218	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,385	08/06/2032	6 100	501	0,07
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	7 400	(15)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	700	23	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,085	13/02/2034	23 920	(8)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	12 900	326	0,05
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,308	21/02/2029	21 700	(195)	(0,03)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	02/04/2026	50 600	(30)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2030	15 300	(16)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	1 600	(22)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	21/06/2025	48 700	673	0,10
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	4 504	(37)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,575	04/01/2027	BRL 39 700	380	0,06
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,250	21/09/2052	CAD 2 600	(195)	(0,03)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,250	21/12/2027	CNY 16 100	19	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	15/12/2026	77 410	120	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,920	26/08/2026	COP 21 200 000	483	0,07
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,925	26/08/2026	20 900 000	(336)	(0,05)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,215	09/02/2027	7 022 570	(91)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,620	18/09/2030	29 000 000	(75)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,585	26/11/2025	21 088 900	34	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,590	26/11/2025	22 207 400	35	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,930	18/09/2030	2 700 000	(52)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,280	26/11/2025	24 084 000	(50)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,270	17/11/2027	16 699 000	356	0,05
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,580	10/01/2028	14 369 470	(231)	(0,03)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,840	02/12/2025	74 238 900	784	0,12
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,960	21/11/2025	11 115 900	(120)	(0,02)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,215	11/02/2027	ILS 24 750	(32)	(0,01)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,268	17/03/2031	KRW 2 741 200	(41)	(0,01)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,336	17/03/2031	1 600 000	(24)	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,500	16/03/2027	6 799 000	(65)	(0,01)
À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	15/03/2028	THB 37 400	0	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,980	21/12/2026	ZAR 151 000	155	0,02
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,690	04/11/2026	133 520	(62)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,850	14/01/2027	CLP 4 026 240	(58)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,045	11/02/2027	454 450	2	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,225	29/07/2027	CZK 86 860	(92)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,081	15/02/2031	€ 24 400	(3 141)	(0,48)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	4 700	107	0,02
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	7 100	17	0,00
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	14 200	122	0,02
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	17 400	8	0,00
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	3,700	08/11/2026	HUF 1 841 500	(233)	(0,04)
À payer	BBR HUF à 6 mois	11,070	02/09/2027	450 700	179	0,03
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	2,983	08/11/2026	PLN 9 840	37	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,745	11/02/2027	MXN 37 430	21	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,480	24/01/2028	188 200	59	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,700	05/11/2027	63 500	30	0,00
					\$ (546)	(0,09)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (502)	(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) 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.

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	\$ (374)	\$ (461)	(0,07)
JPM	Taux plafond - CPURNSA hors cote	234,781	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0	16/05/2024	1 500	(10)	0	0,00
						\$ (384)	\$ (461)	(0,07)

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 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,060	14/07/2023	1 942	\$ (14)	\$ (9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,360	14/07/2023	1 942	(14)	(4)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	1 963	(13)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	1 963	(13)	0	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	1 681	(6)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	1 681	(5)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	2 546	(6)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	2 546	(6)	(9)	0,00
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	2 524	(17)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	2 524	(17)	0	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	4 759	(16)	(10)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	4 759	(16)	(23)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	2 546	(6)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	2 546	(6)	(9)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,250	20/07/2023	5 493	(19)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	5 493	(19)	(23)	(0,01)
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	3 880	(13)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	3 880	(13)	(16)	0,00
							\$ (219)	\$ (138)	(0,02)

(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	\$ (86)	\$ 74	\$ (12)	0,00
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	12 200	(403)	353	(50)	(0,02)
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	2 200	(5)	(19)	(24)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	5 100	(148)	127	(21)	0,00
					\$ (642)	\$ 535	\$ (107)	(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.

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	KLIBOR MYR à 3 mois	2,750 %	15/12/2026	MYR 2 450	\$ (6)	\$ (9)	\$ (15)	0,00
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,000	16/03/2027	40 990	(184)	(15)	(199)	(0,03)
CBK	À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,430	01/07/2029	KRW 100	0	0	0	0,00
						\$ (190)	\$ (24)	\$ (214)	(0,03)

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 payer	Indice DWRTFT Index	1 880	Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	\$ 20 857	23/08/2023	\$ 0	\$ (970)	\$ (970)	(0,14)
BPS	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	S/O	1,084 %	100	20/12/2023	(1)	2	1	0,00
	À payer	Indice IXITR Index	2 419	Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	9 187	21/02/2024	0	(209)	(209)	(0,03)

Tableau des investissements Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation 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 payer	NDUEACWF Index	40 416	Taux LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	\$ 13 822	06/09/2023	\$ 0	\$ (747)	\$ (747)	(0,11)
	À payer	Indice DWRTFT Index	453	Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	5 018	21/02/2024	0	(242)	(242)	(0,04)
MBC	À recevoir	Indice NDUEEGF	24 335	Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	11 953	06/12/2023	0	403	403	0,06
	À recevoir	Indice NDUEEGF	24 335	Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	11 953	17/01/2024	0	404	404	0,06
	À recevoir	Indice NDUEEGF	24 335	Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	11 953	06/03/2024	0	405	405	0,06
MYI	À recevoir	Indice NDUEEGF	24 335	Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	12 419	08/05/2024	0	(53)	(53)	(0,01)
SOG	À payer	Indice DWRTFT Index	1 252	Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	13 886	03/04/2024	0	(650)	(650)	(0,10)
							\$ (1)	\$ (1 657)	\$ (1 658)	(0,25)

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	07/2023	AUD	1 401	\$ 930	\$ 0	\$ (3)	0,00
	07/2023	\$	226	AUD 345	4	4	0,00
	08/2023		931	1 401	3	3	0,00
BOA	07/2023	DKK	342	\$ 50	0	0	0,00
	07/2023	NZD	1 616	980	0	(10)	0,00
	07/2023	SEK	2 505	231	0	0	0,00
	07/2023	\$	1 433	AUD 2 195	28	28	0,00
	07/2023		10 903	CAD 14 836	308	308	0,05
	07/2023		86	DKK 597	1	1	0,00
	07/2023		5 431	ILS 18 604	0	(419)	(0,06)
	07/2023		4 914	MXN 90 475	348	348	0,05
	07/2023		1 124	NOK 12 358	29	29	0,00
	07/2023		98	SEK 1 060	0	0	0,00
	08/2023	CNY	333	\$ 49	2	2	0,00
	08/2023	SEK	1 059	98	0	0	0,00
	08/2023	\$	245	CNY 1 753	0	(2)	0,00
	08/2023		50	DKK 341	0	0	0,00
	08/2023		3 014	ILS 10 304	0	(235)	(0,03)
	09/2023	IDR	291 840	\$ 19	0	0	0,00
	09/2023	TWD	50 832	1 674	39	39	0,01
	09/2023	\$	194	CLP 157 827	1	1	0,00
	09/2023		1 009	HKD 7 888	0	(1)	0,00
	09/2023		297	KRW 381 649	0	(6)	0,00
BPS	07/2023	AUD	1 002	\$ 663	0	(3)	0,00
	07/2023	CHF	667	746	0	0	0,00
	07/2023	CZK	241	11	0	0	0,00
	07/2023	DKK	1 610	232	0	(4)	0,00
	07/2023	€	48 875	53 552	230	230	0,03
	07/2023	ILS	11 722	3 679	520	520	0,08
	07/2023	NOK	2 883	268	0	(1)	0,00
	07/2023	\$	24 932	¥ 3 465 815	0	(954)	(0,14)
	08/2023	CNH	80 072	\$ 11 588	545	545	0,08
	08/2023	CNY	392	57	3	3	0,00
	08/2023	TWD	25 443	833	16	16	0,00
	08/2023	\$	664	AUD 1 002	3	3	0,00
	08/2023		746	CHF 665	0	0	0,00
	08/2023		53 627	€ 48 875	0	(232)	(0,03)
	08/2023		268	NOK 2 880	1	1	0,00
	08/2023	ZAR	39 221	\$ 2 108	40	40	0,01
	09/2023	THB	14	0	0	0	0,00
BRC	07/2023	£	148	188	0	0	0,00
	07/2023	¥	8 387 000	64 844	6 704	6 704	1,01
	07/2023	\$	13	MYR 60	0	0	0,00
	08/2023	CNY	6 672	\$ 953	30	30	0,00
	08/2023	COP	48 730 586	11 438	0	(88)	(0,01)
	08/2023	ZAR	47 456	2 568	66	66	0,01
	09/2023	¥	9 458 000	68 464	2 400	2 400	0,36
	09/2023	\$	170	ILS 608	0	(6)	0,00
CBK	10/2023	MXN	55 614	\$ 2 968	0	(212)	(0,03)
	07/2023	€	2 748	3 006	8	8	0,00
	07/2023	ILS	6 893	2 151	294	294	0,04
	07/2023	\$	3 595	CLP 2 909 470	28	28	0,00
	07/2023		44	NOK 485	2	2	0,00
	08/2023	CLP	3 210 667	\$ 3 912	0	(65)	(0,01)
	08/2023	CNH	220	32	1	1	0,00
	08/2023	ILS	10 315	3 192	410	410	0,06
	08/2023	TWD	34 655	1 136	23	23	0,00
	08/2023	\$	4 364	CNY 30 650	0	(124)	(0,02)
	09/2023	KRW	1 181	\$ 1	0	0	0,00
	09/2023	MXN	8 169	441	0	(27)	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
CLY	07/2023	\$ 253	DKK 1 755	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
DUB	07/2023	5 418	BRL 29 357	667	0	667	0,10
	08/2023	106	ZAR 2 038	2	0	2	0,00
FAR	07/2023	5	CLP 3 986	0	0	0	0,00
GLM	07/2023	BRL 29 447	\$ 6 094	0	(10)	(10)	0,00
	07/2023	NOK 17 783	1 650	0	(10)	(10)	0,00
	08/2023	\$ 319	CNY 2 198	0	(15)	(15)	0,00
	08/2023	1 650	NOK 17 765	10	0	10	0,00
	09/2023	SGD 2 357	\$ 1 764	17	0	17	0,00
	09/2023	\$ 5 898	BRL 28 794	5	0	5	0,00
	09/2023	348	COP 1 472 799	0	(3)	(3)	0,00
	09/2023	920	TWD 27 985	0	(19)	(19)	0,00
JPM	07/2023	¥ 1 180 269	\$ 8 253	87	0	87	0,01
	07/2023	\$ 1 378	AUD 2 108	25	0	25	0,00
	07/2023	1 130	SGD 1 493	0	(26)	(26)	0,00
	08/2023	CNH 64 275	\$ 9 301	437	0	437	0,07
	08/2023	CNY 414	60	3	0	3	0,00
	08/2023	\$ 1 363	HUF 475 800	12	0	12	0,00
	08/2023	8 253	¥ 1 175 254	0	(87)	(87)	(0,01)
	08/2023	247	TWD 7 550	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023	ZAR 3 516	\$ 181	0	(4)	(4)	0,00
	09/2023	IDR 122 083	8	0	0	0	0,00
	09/2023	INR 44 392	539	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	PEN 1 675	455	0	(4)	(4)	0,00
	09/2023	\$ 5	IDR 78 757	0	0	0	0,00
	09/2023	164	ILS 583	0	(7)	(7)	0,00
	09/2023	2 336	THB 80 101	0	(60)	(60)	(0,01)
	10/2023	MXN 26 988	\$ 1 537	0	(6)	(6)	0,00
MBC	07/2023	CHF 592	657	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	£ 3 233	4 002	0	(108)	(108)	(0,02)
	09/2023	¥ 2 520 000	18 357	738	0	738	0,11
	09/2023	\$ 227	INR 18 794	1	0	1	0,00
	09/2023	175	KRW 223 406	0	(5)	(5)	0,00
MYI	07/2023	AUD 521	\$ 349	2	0	2	0,00
	07/2023	£ 96	119	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	IDR 76 925	5	0	0	0	0,00
	07/2023	NZD 107	65	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 3 999	COP 16 859 264	13	0	13	0,00
	07/2023	118	€ 108	0	0	0	0,00
	07/2023	39	£ 31	0	0	0	0,00
	07/2023	5	IDR 76 925	0	0	0	0,00
	07/2023	135	SEK 1 446	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	TWD 27 379	\$ 903	24	0	24	0,00
	08/2023	\$ 2	TWD 72	0	0	0	0,00
	08/2023	560	ZAR 10 502	4	(11)	(7)	0,00
	09/2023	IDR 76 992	\$ 5	0	0	0	0,00
	09/2023	ILS 193	54	2	0	2	0,00
	09/2023	INR 9 588	116	0	0	0	0,00
	09/2023	\$ 196	KRW 251 072	0	(5)	(5)	0,00
	09/2023	1 066	THB 36 512	0	(29)	(29)	0,00
RBC	07/2023	CAD 857	\$ 649	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 3 063	MXN 58 943	367	0	367	0,06
	08/2023	MXN 63 121	\$ 3 642	0	(8)	(8)	0,00
	09/2023	ZAR 30 034	1 668	91	0	91	0,01
RYL	07/2023	\$ 2 206	NZD 3 553	0	(29)	(29)	0,00
SCX	07/2023	AUD 2 058	\$ 1 366	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	NZD 4 208	2 555	0	(23)	(23)	0,00
	07/2023	\$ 2 055	AUD 3 145	38	0	38	0,01
	07/2023	1 350	CHF 1 213	6	0	6	0,00
	08/2023	CNH 30 465	\$ 4 428	226	0	226	0,03
	08/2023	CNY 1 098	161	9	0	9	0,00
	08/2023	\$ 1 367	AUD 2 058	4	0	4	0,00
	09/2023	INR 27 764	\$ 337	0	0	0	0,00
	09/2023	TWD 42 475	1 393	27	0	27	0,00
	09/2023	\$ 5 245	IDR 77 991 713	0	(65)	(65)	(0,01)
	09/2023	2 400	THB 82 892	0	(45)	(45)	(0,01)
	09/2023	1 149	ZAR 19 983	0	(99)	(99)	(0,01)
SOG	07/2023	1 490	AUD 2 277	26	0	26	0,00
	07/2023	55 533	€ 51 623	788	0	788	0,12
SSB	07/2023	CLP 2 605 728	\$ 3 244	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$ 3 244	CLP 2 613 253	0	0	0	0,00
	09/2023	BRL 6 702	\$ 1 322	0	(52)	(52)	(0,01)
TOR	07/2023	AUD 2 533	1 673	0	(13)	(13)	0,00
	07/2023	CAD 9 906	7 464	0	(22)	(22)	0,00
	07/2023	\$ 788	AUD 1 205	14	0	14	0,00
	07/2023	4 418	£ 3 477	2	0	2	0,00
	07/2023	1 448	NZD 2 378	9	0	9	0,00
	08/2023	£ 3 477	\$ 4 419	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	NZD 2 378	1 448	0	(9)	(9)	0,00
	08/2023	\$ 1 674	AUD 2 533	13	0	13	0,00
	08/2023	7 464	CAD 9 902	22	0	22	0,00
	08/2023	861	HUF 301 368	10	0	10	0,00
UAG	07/2023	AUD 4 036	\$ 2 695	14	(6)	8	0,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation 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
	07/2023	\$ 181	AUD 276	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07/2023	88	CHF 79	0	0	0	0,00
	07/2023	781	NOK 8 645	26	0	26	0,00
	08/2023	2 697	AUD 4 036	6	(14)	(8)	0,00
	09/2023	90	ILS 322	0	(3)	(3)	0,00
	09/2023	569	ZAR 10 051	0	(41)	(41)	(0,01)
				\$ 15 842	\$ (3 253)	\$ 12 589	1,89

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD 266	\$ 174	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	07/2023	\$ 672	AUD 1 013	2	0	2	0,00
	08/2023	AUD 1 013	\$ 673	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07/2023	1 694	1 106	0	(22)	(22)	0,00
	07/2023	CAD 12 264	9 013	0	(256)	(256)	(0,04)
	07/2023	CLP 144 422	178	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	DKK 3 711	536	0	(8)	(8)	0,00
	07/2023	€ 2 002	2 186	3	(1)	2	0,00
	07/2023	HUF 60 219	173	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	¥ 75 749	545	21	0	21	0,00
	07/2023	KRW 17 816	13	0	0	0	0,00
	07/2023	NOK 2 493	227	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	NZD 109	66	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	SEK 186	17	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 5	BRL 25	0	0	0	0,00
	07/2023	179	CLP 144 422	1	0	1	0,00
	07/2023	991	DKK 6 736	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	137 943	€ 128 354	2 093	0	2 093	0,31
	07/2023	854	THB 30 392	3	0	3	0,00
	08/2023	CLP 144 422	\$ 178	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	DKK 6 725	991	4	0	4	0,00
	08/2023	THB 30 392	856	0	(3)	(3)	0,00
BPS	07/2023	BRL 0	0	0	0	0	0,00
	07/2023	CHF 83	92	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	CZK 3 195	145	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	DKK 13	2	0	0	0	0,00
	07/2023	€ 143 429	157 156	675	0	675	0,10
	07/2023	¥ 2 121 726	15 271	593	0	593	0,09
	07/2023	NZD 10	6	0	0	0	0,00
	07/2023	TWD 158 157	5 164	87	0	87	0,01
	07/2023	\$ 1 008	AUD 1 533	13	0	13	0,00
	07/2023	7 374	CHF 6 595	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	1 741	CNY 12 580	0	(8)	(8)	0,00
	07/2023	154 756	€ 143 957	2 302	0	2 302	0,35
	07/2023	57	NOK 608	0	0	0	0,00
	08/2023	AUD 724	\$ 480	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	CHF 6 576	7 374	2	0	2	0,00
	08/2023	CNY 12 562	1 741	5	0	5	0,00
	08/2023	NOK 608	57	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 156 997	€ 143 083	0	(680)	(680)	(0,10)
BRC	07/2023	PLN 1 320	\$ 313	0	(12)	(12)	0,00
	07/2023	\$ 4 082	KRW 5 388 015	7	0	7	0,00
	08/2023	KRW 5 381 238	\$ 4 082	0	(7)	(7)	0,00
CBK	07/2023	€ 122 100	132 751	18	(479)	(461)	(0,07)
	07/2023	INR 138	2	0	0	0	0,00
	07/2023	MXN 15 257	848	0	(42)	(42)	(0,01)
	07/2023	NOK 222	20	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 1 827	BRL 8 735	0	(16)	(16)	0,00
	07/2023	219	ILS 796	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	888	MXN 15 257	2	0	2	0,00
	07/2023	5 091	TWD 158 638	2	0	2	0,00
	08/2023	BRL 8 735	\$ 1 817	15	0	15	0,00
	08/2023	ILS 795	219	5	0	5	0,00
	08/2023	MXN 15 257	883	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	TWD 158 640	5 091	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 123 117	€ 113 082	425	0	425	0,06
CLY	07/2023	DKK 10 906	\$ 1 574	0	(24)	(24)	0,00
	07/2023	\$ 185	CHF 167	1	0	1	0,00
	08/2023	CHF 166	\$ 185	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07/2023	BRL 8 760	1 749	0	(67)	(67)	(0,01)
	07/2023	MYR 3 191	711	28	0	28	0,00
	07/2023	THB 30 392	880	23	0	23	0,00
	07/2023	\$ 348	NOK 3 753	2	0	2	0,00
	08/2023	NOK 3 749	\$ 348	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07/2023	AUD 1 627	1 064	0	(19)	(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	
	07/2023	€	143 271	\$ 156 438	\$ 129	\$ 0	\$ 129	0,02
	07/2023	INR	360 848	4 357	0	(41)	(41)	(0,01)
	07/2023	\$	4 399	INR 361 160	3	0	3	0,00
	07/2023		5 233	¥ 748 341	0	(55)	(55)	(0,01)
	07/2023		41	SGD 55	0	0	0	0,00
	07/2023	ZAR	13 394	\$ 675	0	(34)	(34)	(0,01)
	08/2023	INR	361 490	4 399	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	¥	745 161	5 233	55	0	55	0,01
	08/2023	SGD	55	41	0	0	0	0,00
	08/2023	\$	156 656	€ 143 271	0	(135)	(135)	(0,02)
MBC	07/2023	CNY	88	\$ 12	0	0	0	0,00
	07/2023	€	5 409	5 873	14	(43)	(29)	0,00
	07/2023	£	9 360	11 586	0	(314)	(314)	(0,05)
	07/2023	SEK	346	32	0	0	0	0,00
	07/2023	SGD	1 062	786	1	0	1	0,00
	07/2023	\$	795	CAD 1 078	19	0	19	0,00
	07/2023		63	€ 58	1	0	1	0,00
MYI	07/2023		1 229	£ 986	25	0	25	0,00
	07/2023	CHF	0	\$ 0	0	0	0	0,00
	07/2023	ILS	794	213	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	PHP	30 827	552	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	SEK	26 711	2 488	15	0	15	0,00
	07/2023	\$	147	CZK 3 195	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023		881	DKK 6 007	0	0	0	0,00
	07/2023		952	IDR 14 342 248	4	0	4	0,00
	07/2023		688	MYR 3 191	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023		326	PLN 1 321	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023		2 527	SEK 27 285	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023		814	SGD 1 100	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	ZAR	14 424	\$ 732	0	(32)	(32)	0,00
	08/2023	CZK	3 199	147	1	0	1	0,00
	08/2023	DKK	5 997	881	0	0	0	0,00
	08/2023	IDR	14 347 672	952	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	MYR	3 191	689	4	0	4	0,00
	08/2023	PLN	1 323	326	1	0	1	0,00
	08/2023	SEK	27 251	2 527	1	0	1	0,00
SCX	08/2023	SGD	1 099	814	1	0	1	0,00
	07/2023	AUD	2 296	1 501	0	(28)	(28)	0,00
	07/2023	CHF	6 426	7 151	0	(31)	(31)	0,00
	07/2023	NZD	284	172	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$	988	AUD 1 488	3	0	3	0,00
	07/2023		1	IDR 20 238	0	0	0	0,00
SOG	08/2023	AUD	1 488	\$ 988	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023		1 757	1 150	0	(20)	(20)	0,00
	07/2023	HKD	65 217	8 332	10	0	10	0,00
	07/2023	\$	154 765	€ 143 868	2 197	0	2 197	0,33
	07/2023		1 491	ZAR 27 856	0	(16)	(16)	0,00
TOR	08/2023	ZAR	27 934	\$ 1 491	16	0	16	0,00
	07/2023	AUD	930	608	0	(11)	(11)	0,00
	07/2023	\$	1 209	AUD 1 831	9	0	9	0,00
	07/2023		8 455	CAD 11 187	6	(6)	0	0,00
	07/2023		10 640	£ 8 374	5	0	5	0,00
	07/2023		179	HUF 60 339	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023		10 063	¥ 1 449 033	0	(37)	(37)	(0,01)
	07/2023		245	NZD 402	1	0	1	0,00
	08/2023	AUD	1 831	\$ 1 210	0	(9)	(9)	0,00
	08/2023	CAD	11 183	8 455	6	(6)	0	0,00
	08/2023	£	8 374	10 643	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023	HUF	60 795	179	2	0	2	0,00
	08/2023	¥	1 442 888	10 063	38	0	38	0,01
UAG	08/2023	NZD	402	245	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	AUD	213	139	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	CHF	418	466	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	CNY	12 526	1 782	56	0	56	0,01
	07/2023	IDR	14 287 784	952	0	0	0	0,00
	07/2023	KRW	5 360 687	4 065	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	NOK	1 820	164	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	SGD	94	69	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	1 948	AUD 2 918	4	(10)	(6)	0,00
	07/2023		181	CHF 162	0	0	0	0,00
	07/2023		557	PHP 30 861	2	0	2	0,00
	08/2023	AUD	2 918	\$ 1 950	10	(4)	6	0,00
	08/2023	CHF	162	181	0	0	0	0,00
	08/2023	PHP	30 878	557	0	(1)	(1)	0,00
					\$ 8 971	\$ (2 564)	\$ 6 407	0,96

Tableau des investissements Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (suite)

Au 30 juin 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		
AZD	07/2023	AUD	\$	4	3	\$ 0	\$ 0	0,00	
	07/2023	\$	AUD	6	9	0	0	0,00	
BOA	08/2023	AUD	\$	9	6	0	0	0,00	
	07/2023			5	3	0	0	0,00	
	07/2023	CAD		100	74	0	(2)	0,00	
	07/2023	CLP	2 256		3	0	0	0,00	
	07/2023	CNY	1		0	0	0	0,00	
	07/2023	DKK	34		5	0	0	0,00	
	07/2023	HUF	728		2	0	0	0,00	
	07/2023	¥	1 574		11	0	0	0,00	
	07/2023	KRW	126		0	0	0	0,00	
	07/2023	NOK	30		3	0	0	0,00	
	07/2023	NZD	1		1	0	0	0,00	
	07/2023	SEK	4		0	0	0	0,00	
	07/2023	\$	0	BRL	0	0	0	0,00	
	07/2023		3	CLP	2 256	0	0	0,00	
	07/2023		9	DKK	62	0	0	0,00	
	07/2023		20	SEK	212	0	0	0,00	
	07/2023		8	THB	302	0	0	0,00	
	BPS	08/2023	CLP	2 256		3	0	0	0,00
		08/2023	DKK	62		9	0	0	0,00
		08/2023	SEK	212		20	0	0	0,00
08/2023		THB	302		9	0	0	0,00	
07/2023		BRL	0		0	0	0	0,00	
07/2023		CHF	1		1	0	0	0,00	
07/2023		CZK	38		2	0	0	0,00	
07/2023		DKK	0		0	0	0	0,00	
07/2023		¥	17 100		123	5	5	0,00	
07/2023		NZD	0		0	0	0	0,00	
07/2023		TWD	1 187		39	1	1	0,00	
07/2023		\$	4	AUD	6	0	0	0,00	
07/2023			60	CHF	54	0	0	0,00	
07/2023			14	CNY	101	0	0	0,00	
07/2023			205	€	187	0	(1)	0,00	
07/2023			1 217	£	984	34	34	0,01	
07/2023			1	NOK	7	0	0	0,00	
08/2023		AUD	6	\$	4	0	0	0,00	
08/2023		CHF	54		60	0	0	0,00	
08/2023		CNY	101		14	0	0	0,00	
08/2023	€	184		202	1	1	0,00		
08/2023	NOK	7		1	0	0	0,00		
07/2023	£	48		62	0	0	0,00		
07/2023	PLN	16		4	0	0	0,00		
07/2023	\$	29	KRW	38 167	0	0	0,00		
08/2023	KRW	38 119	\$	29	0	0	0,00		
CBK	07/2023	INR	1		0	0	0	0,00	
	07/2023	MXN	171		10	0	0	0,00	
	07/2023	NOK	3		0	0	0	0,00	
	07/2023	\$	14	BRL	69	0	0	0,00	
	07/2023		5	€	4	0	0	0,00	
	07/2023		3	ILS	12	0	0	0,00	
	07/2023		10	MXN	171	0	0	0,00	
	07/2023		38	TWD	1 191	0	0	0,00	
	08/2023	BRL	69	\$	14	0	0	0,00	
	08/2023	ILS	12		3	0	0	0,00	
CLY	08/2023	MXN	171		10	0	0	0,00	
	08/2023	TWD	1 191		38	0	0	0,00	
GLM	07/2023	DKK	100		14	0	0	0,00	
	07/2023	\$	2	CHF	1	0	0	0,00	
JPM	08/2023	CHF	1		2	0	0	0,00	
	07/2023	BRL	69		14	0	(1)	0,00	
	07/2023	MYR	22		5	0	0	0,00	
	07/2023	THB	302		9	0	0	0,00	
MBC	07/2023	\$	4	NOK	45	0	0	0,00	
	08/2023	NOK	45	\$	4	0	0	0,00	
	07/2023	£	1 064		1 345	0	(7)	(0,01)	
	07/2023	INR	2 769		33	0	0	0,00	
	07/2023	\$	34	INR	2 772	0	0	0,00	
	07/2023		44	¥	6 359	0	(1)	0,00	
	07/2023		0	SGD	1	0	0	0,00	
	08/2023	INR	2 774	\$	34	0	0	0,00	
MYI	08/2023	¥	6 332		44	0	0	0,00	
	08/2023	SGD	1		0	0	0	0,00	
	08/2023	\$	1 345	£	1 064	7	7	0,00	
	07/2023	CAD	0	\$	0	0	0	0,00	
MYI	07/2023	£	17		21	0	0	0,00	
	07/2023	SGD	10		8	0	0	0,00	
	07/2023	\$	1 355	£	1 094	36	36	0,01	
MYI	07/2023	ILS	12	\$	3	0	0	0,00	
	07/2023	PHP	147		3	0	0	0,00	
	07/2023	SEK	208		19	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	
	07/2023	\$	2 CZK	39	\$ 0	\$ 0	0,00	
	07/2023		8 DKK	55	0	0	0,00	
	07/2023		1 318 £	1 060	30	0	0,00	
	07/2023		6 IDR	87 612	0	0	0,00	
	07/2023		5 MYR	22	0	0	0,00	
	07/2023		4 PLN	16	0	0	0,00	
	07/2023		8 SGD	11	0	0	0,00	
	07/2023	ZAR	191	\$ 10	0	0	0,00	
	08/2023	CZK	39	2	0	0	0,00	
	08/2023	DKK	55	8	0	0	0,00	
	08/2023	IDR	87 645	6	0	0	0,00	
	08/2023	MYR	22	5	0	0	0,00	
	08/2023	PLN	16	4	0	0	0,00	
	08/2023	SGD	11	8	0	0	0,00	
SCX	07/2023	AUD	18	12	0	0	0,00	
	07/2023	CHF	52	58	0	0	0,00	
	07/2023	NZD	3	2	0	0	0,00	
	07/2023	\$	9 AUD	13	0	0	0,00	
	07/2023		0 IDR	124	0	0	0,00	
	08/2023	AUD	13	\$ 9	0	0	0,00	
SOG	07/2023		27	18	0	0	0,00	
	07/2023	€	192	206	0	(3)	0,00	
	07/2023	HKD	554	71	0	0	0,00	
	07/2023	\$	10 ZAR	191	0	0	0,00	
	08/2023	ZAR	192	\$ 10	0	0	0,00	
TOR	07/2023	AUD	14	9	0	0	0,00	
	07/2023	£	1 064	1 353	0	(1)	0,00	
	07/2023	\$	11 AUD	16	0	0	0,00	
	07/2023		76 CAD	100	0	0	0,00	
	07/2023		2 HUF	730	0	0	0,00	
	07/2023		86 ¥	12 314	0	0	0,00	
	07/2023		3 NZD	5	0	0	0,00	
	08/2023	AUD	16	\$ 11	0	0	0,00	
	08/2023	CAD	100	76	0	0	0,00	
	08/2023	HUF	735	2	0	0	0,00	
	08/2023	¥	12 262	86	0	0	0,00	
	08/2023	NZD	5	3	0	0	0,00	
	08/2023	\$	1 353 £	1 064	1	1	0,00	
UAG	07/2023	AUD	3	\$ 2	0	0	0,00	
	07/2023	CHF	3	4	0	0	0,00	
	07/2023	CNY	101	14	0	0	0,00	
	07/2023	CZK	0	0	0	0	0,00	
	07/2023	IDR	87 279	6	0	0	0,00	
	07/2023	KRW	37 973	29	0	0	0,00	
	07/2023	NOK	22	2	0	0	0,00	
	07/2023	SGD	1	1	0	0	0,00	
	07/2023	\$	17 AUD	26	0	0	0,00	
	07/2023		1 CHF	1	0	0	0,00	
	07/2023		3 PHP	147	0	0	0,00	
	08/2023	AUD	26	\$ 17	0	0	0,00	
	08/2023	CHF	1	1	0	0	0,00	
	08/2023	PHP	148	3	0	0	0,00	
					\$ 115	\$ (16)	\$ 99	0,01
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ 16 517	2,47	
Total des Investissements						\$ 804 155	120,28	
Autres actifs et passifs à court terme						\$ (135 568)	(20,28)	
Actifs nets						\$ 668 587	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) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.
- (g) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 28 492 \$ (31 décembre 2022 : 35 607 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 900 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 2023.

Tableau des investissements Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation 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 30 juin 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	\$ 56 789	\$ 467 029	\$ 356	\$ 524 174
Fonds d'investissement	236 945	0	0	236 945
Contrats de mise en pension	0	18 513	0	18 513
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	8 565	15 958	0	24 523
Totaux	\$ 302 299	\$ 501 500	\$ 356	\$ 804 155

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 0	\$ 1	\$ S/O	\$ S/O	\$ S/O
BOA	701	(410)	291	(3 503)	1 500	(2 003)
BOM	S/O	S/O	S/O	2	0	2
BPS	2 978	(2 580)	398	485	(1 380)	(895)
BRC	8 857	(8 250)	607	(222)	450	228
BSH	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)
CBK	472	(300)	172	4 514	(4 480)	34
CLY	(20)	0	(20)	(53)	0	(53)
DUB	669	(500)	169	13	0	13
GLM	(550)	120	(430)	(829)	420	(409)
GST	(12)	10	(2)	15	(20)	(5)
JPM	(755)	590	(165)	(36)	(590)	(626)
MBC	1 572	(1 510)	62	1 039	(1 100)	(61)
MEI	S/O	S/O	S/O	7	(440)	(433)
MYC	(73)	180	107	(27)	180	153
MYI	(51)	0	(51)	(55)	780	725
RBC	451	(320)	131	(57)	0	(57)
RYL	(29)	0	(29)	(21)	0	(21)
SAL	(24)	0	(24)	(18)	0	(18)
SCX	13	0	13	4 106	(3 980)	126
SOG	2 348	(1 670)	678	(81)	(280)	(361)
SSB	(53)	0	(53)	(463)	590	127
TOR	14	0	14	(838)	690	(148)
UAG	8	0	8	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	31,35	25,87
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	47,06	35,98
Autres valeurs mobilières	S/O	1,28
Fonds d'investissement	35,44	33,53
Contrats de mise en pension	2,77	2,47
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	1,27	(2,13)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,08)	(0,30)
Instruments financiers dérivés hors cote	2,47	0,45

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	3,30	3,39
Obligations et billets convertibles	0,14	0,12
Agences du gouvernement américain	21,74	4,77
Obligations du Trésor américain	7,17	1,20
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	1,79	1,66
Titres adossés à des actifs	8,37	7,95
Émissions souveraines	6,26	7,97
Actions ordinaires	1,75	6,88
Titres privilégiés	0,03	0,16
Sociétés d'investissement immobilier	6,75	5,86
Instruments à court terme	21,11	23,17
Fonds d'investissement	35,44	33,53
Contrats de mise en pension	2,77	2,47
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	1,27	(2,13)
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	(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	0,02	0,07
Swaps de taux d'intérêt	(0,09)	(0,36)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Options plafonnées sur l'inflation	(0,07)	(0,06)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,02)	(0,01)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	(0,02)	(0,01)
Swaps de taux d'intérêt	(0,03)	(0,04)
Swaps de rendement total sur indices	(0,25)	0,05
Swaps de rendement total sur titres	S/O	0,02
Contrats de change à terme	1,89	(0,87)
Contrats de change à terme couverts	0,97	1,37
Autres actifs et passifs à court terme	(20,28)	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
Loarre Investments SARL 6,500 % éch. 15/05/2029	€ 5 000	\$ 5 193	0,17	NORVÈGE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Market Bidco Finco PLC 5,500 % éch. 04/11/2027	£ 10 300	\$ 10 230	0,33
Monitchem HoldCo 3 S.A. 8,750 % éch. 01/05/2028	700	756	0,03	Adevinta ASA 2,625 % éch. 15/11/2025 3,000 % éch. 15/11/2027	€ 7 000 2 750	\$ 7 340 2 797	0,24 0,09	Marks & Spencer PLC 3,750 % éch. 19/05/2026	100	115	0,00
Summer BC Holdco SARL 5,750 % éch. 31/10/2026 9,250 % éch. 31/10/2027	4 000 3 154	3 892 2 843	0,13 0,09	Total Norvège		10 137	0,33	PEU Fin PLC 7,250 % éch. 01/07/2028	€ 1 200	1 312	0,04
Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % éch. 15/11/2033 7,200 % éch. 18/07/2036	\$ 7 000 3 000	5 945 2 582	0,19 0,08	PANAMA OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Rolls-Royce PLC 0,875 % éch. 09/05/2024 4,625 % éch. 16/02/2026	3 000 2 500	3 174 2 688	0,10 0,09
Total Luxembourg		100 314	3,27	Carnival Corp. 4,000 % éch. 01/08/2028 5,750 % éch. 01/03/2027 6,000 % éch. 01/05/2029 7,625 % éch. 01/03/2026	\$ 7 000 10 000 2 000 3 000	6 212 9 215 1 788 2 941	0,20 0,30 0,06 0,10	5,750 % éch. 15/10/2027	£ 4 000	4 728	0,15
MULTINATIONALES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Panama		20 156	0,66	Thames Water Kemble Finance PLC 4,625 % éch. 19/05/2026	850	562	0,02
Allied Universal Holdco LLC 3,625 % éch. 01/06/2028 4,875 % éch. 01/06/2028	€ 6 000 4 250	5 259 4 219	0,17 0,14	ESPAGNE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % éch. 15/01/2030	20 000	20 072	0,65
American Airlines, Inc. 5,500 % éch. 20/04/2029	\$ 16 300 10 800	16 163 10 496	0,53 0,34	Cellnex Finance Co. S.A. 2,000 % éch. 15/09/2032 2,000 % éch. 15/02/2033 3,875 % éch. 07/07/2041	€ 10 000 3 000 2 400	8 607 2 554 1 761	0,28 0,08 0,06	Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % éch. 31/01/2031 4,750 % éch. 15/07/2031	€ 10 750 \$ 6 250	9 662 5 203	0,32 0,17
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3,000 % éch. 01/09/2029 3,250 % éch. 01/09/2028 4,000 % éch. 01/09/2029	€ 3 075 \$ 3 000 1 000	2 506 2 580 793	0,08 0,08 0,03	Cellnex Telecom S.A. 1,000 % éch. 20/04/2027 1,875 % éch. 26/06/2029	€ 4 100 5 000	3 925 4 615	0,13 0,15	Vodafone Group PLC 7,000 % éch. 04/04/2029	4 000	4 109	0,13
Clarios Global LP 4,375 % éch. 15/05/2026	€ 10 000	10 431	0,34	Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % éch. 15/10/2028	14 800	13 857	0,45	Zenith Finco PLC 6,500 % éch. 30/06/2027	£ 3 000	2 912	0,10
Connect Finco SARL 6,750 % éch. 01/10/2026	\$ 5 000	4 861	0,16	Grifols S.A. 2,250 % éch. 15/11/2027 3,200 % éch. 01/05/2025	5 000 6 500	4 951 6 918	0,16 0,23	Total Royaume-Uni		128 317	4,18
Paysafe Finance PLC 3,000 % éch. 15/06/2029 4,000 % éch. 15/06/2029	€ 1 875 \$ 4 500	1 590 3 542	0,05 0,11	Kaixo Bondco Telecom S.A. 5,125 % éch. 30/09/2029	7 000	6 671	0,22	ÉTATS-UNIS OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Total Multinationales		62 440	2,03	Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % éch. 18/09/2027	14 000	13 968	0,45	Academy Ltd. 6,000 % éch. 15/11/2027	\$ 5 000	4 806	0,16
PAYS-BAS OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Espagne		67 827	2,21	Acadia Healthcare Co., Inc. 5,000 % éch. 15/04/2029	5 000	4 615	0,15
Ashland Services BV 2,000 % éch. 30/01/2028	€ 15 000	13 942	0,45	SUÈDE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				AdaptHealth LLC 5,125 % éch. 01/03/2030 6,125 % éch. 01/08/2028	1 000 2 000	811 1 735	0,03 0,06
Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 3,750 % éch. 15/01/2025	10 000	10 743	0,35	Dometic Group AB 2,000 % éch. 29/09/2028	5 000	4 418	0,14	ADT Security Corp. 4,875 % éch. 15/07/2032	4 000	3 426	0,11
Clear Channel International BV 6,625 % éch. 01/08/2025	\$ 3 000	2 989	0,10	Intrum AB 3,000 % éch. 15/09/2027 3,500 % éch. 15/07/2026 9,250 % éch. 15/03/2028 (i)	7 500 2 000 3 584	5 683 1 630 3 318	0,19 0,05 0,11	Advantage Sales & Marketing, Inc. 6,500 % éch. 15/11/2028	7 000	5 926	0,19
Diamond BC BV 4,625 % éch. 01/10/2029	12 000	12 113	0,40	Verisure Holding AB 3,250 % éch. 15/02/2027	10 000	9 720	0,32	Albertsons Cos., Inc. 3,500 % éch. 15/03/2029 4,625 % éch. 15/01/2027 6,500 % éch. 15/02/2028	5 000 2 000 5 000	4 333 1 897 5 014	0,14 0,06 0,16
Dufry One BV 2,000 % éch. 15/02/2027 (i) 3,375 % éch. 15/04/2028	€ 14 250 10 000	13 602 9 690	0,44 0,32	Verisure Midholding AB 5,250 % éch. 15/02/2029	2 650	2 513	0,08	Alliant Travel Co. 7,250 % éch. 15/08/2027	10 500	10 472	0,34
Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % éch. 30/06/2029	5 000	4 412	0,14	Total Suède		27 282	0,89	Allison Transmission, Inc. 3,750 % éch. 30/01/2031 4,750 % éch. 01/10/2027	2 000 2 000	1 691 1 886	0,06 0,06
IPD 3 BV 8,000 % éch. 15/06/2028	1 200	1 339	0,04	ROYAUME-UNI OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				AMC Networks, Inc. 4,250 % éch. 15/02/2029 4,750 % éch. 01/08/2025	7 000 8 300	3 771 7 267	0,12 0,24
LeasePlan Corp. NV 7,375 % éch. 29/05/2024 (e)(g)	7 000	7 508	0,25	BPC Modular Services Finance PLC 4,750 % éch. 30/11/2028 6,750 % éch. 30/11/2029	10 000 8 000	9 327 6 655	0,30 0,22	American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % éch. 01/11/2028	300	270	0,01
OI European Group BV 6,250 % éch. 15/05/2028	800	894	0,03	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£ 10 000	10 671	0,35	American Airlines, Inc. 7,250 % éch. 15/02/2028	900	896	0,03
Q-Park Holding BV 1,500 % éch. 01/03/2025 2,000 % éch. 01/03/2027	4 000 7 000	4 196 6 551	0,14 0,21	Carnival PLC 1,000 % éch. 28/10/2029	€ 8 000	5 490	0,18	American Builders & Contractors Supply Co., Inc. 3,875 % éch. 15/11/2029 4,000 % éch. 15/01/2028	4 500 10 000	3 848 9 123	0,13 0,30
Sensata Technologies BV 5,000 % éch. 01/10/2025	\$ 1 000	980	0,03	Harbour Energy PLC 5,500 % éch. 15/10/2026	\$ 2 100	1 933	0,06	Amsted Industries, Inc. 4,625 % éch. 15/05/2030	5 000	4 465	0,15
Trivium Packaging Finance BV 3,750 % éch. 15/08/2026	€ 5 000	5 050	0,16	Heathrow Finance PLC 4,125 % éch. 01/09/2029	£ 3 333	3 441	0,11	AmWINS Group, Inc. 4,875 % éch. 30/06/2029	5 000	4 520	0,15
United Group BV 3,125 % éch. 15/02/2026 3,625 % éch. 15/02/2028 4,000 % éch. 15/11/2027	5 000 18 830 1 500	4 775 16 350 1 347	0,16 0,53 0,04	INEOS Finance PLC 2,875 % éch. 01/05/2026	€ 5 000	5 015	0,16	ANGI Group LLC 3,875 % éch. 15/08/2028	2 000	1 635	0,05
UPC Holding BV 3,875 % éch. 15/06/2029	8 000	7 028	0,23	INEOS Quattro Finance PLC 2,500 % éch. 15/01/2026 3,750 % éch. 15/07/2026	4 000 2 475	3 920 2 385	0,13 0,08	Antero Midstream Partners LP 5,375 % éch. 15/06/2029	5 000	4 651	0,15
ZF Europe Finance BV 2,000 % éch. 23/02/2026 3,000 % éch. 23/10/2029	3 000 5 600	2 985 5 170	0,10 0,17	International Game Technology PLC 2,375 % éch. 15/04/2028 6,500 % éch. 15/02/2025	€ 8 000 \$ 1 133	7 842 1 134	0,26 0,04	Antero Resources Corp. 5,375 % éch. 01/03/2030	4 000	3 707	0,12
Ziggo Bond Co. BV 3,375 % éch. 28/02/2030 6,000 % éch. 15/01/2027	5 000 \$ 2 500	4 032 2 298	0,13 0,08	Lloyds Banking Group PLC 7,500 % éch. 27/06/2024 (e)(g)	6 000	5 737	0,19	Apache Corp. 4,875 % éch. 15/11/2027	5 000	4 645	0,15
Ziggo BV 2,875 % éch. 15/01/2030	€ 5 000	4 412	0,14	Total Pays-Bas		142 406	4,64	API Group DE, Inc. 4,750 % éch. 15/10/2029	3 000	2 705	0,09

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
Avantor Funding, Inc. 3,875 % éch. 15/07/2028	€ 4 750	\$ 4 762	0,16	Coinbase Global, Inc. 3,375 % éch. 01/10/2028	\$ 1 000	\$ 670	0,02	EQM Midstream Partners LP 4,000 % éch. 01/08/2024	\$ 1 871	\$ 1 832	0,06
4,625 % éch. 15/07/2028	\$ 2 500	2 320	0,08	3,625 % éch. 01/10/2031	1 000	592	0,02	4,500 % éch. 15/01/2029	10 550	9 421	0,31
Ball Corp. 1,500 % éch. 15/03/2027	€ 5 000	4 892	0,16	CommScope, Inc. 4,750 % éch. 01/09/2029	7 500	5 920	0,19	4,750 % éch. 15/01/2031	5 050	4 430	0,14
2,875 % éch. 15/08/2030	\$ 7 500	6 233	0,20	6,000 % éch. 01/03/2026	2 000	1 866	0,06	6,000 % éch. 01/07/2025	735	728	0,02
3,125 % éch. 15/09/2031	4 000	3 295	0,11	Community Health Systems, Inc. 4,750 % éch. 15/02/2031	5 000	3 784	0,12	6,500 % éch. 01/07/2027	2 000	1 975	0,06
Bath & Body Works, Inc. 6,625 % éch. 01/10/2030	4 000	3 866	0,13	5,250 % éch. 15/05/2030	5 000	3 944	0,13	6,500 % éch. 15/07/2048	4 000	3 624	0,12
6,875 % éch. 01/11/2035	7 000	6 416	0,21	5,625 % éch. 15/03/2027	8 000	7 058	0,23	7,500 % éch. 01/06/2027	1 000	1 011	0,03
BCPE Empire Holdings, Inc. 7,625 % éch. 01/05/2027	12 000	11 173	0,36	6,000 % éch. 15/01/2029	1 625	1 369	0,04	Fertitta Entertainment LLC 4,625 % éch. 15/01/2029	2 000	1 757	0,06
Black Knight InfoServ LLC 3,625 % éch. 01/09/2028	5 000	4 488	0,15	6,875 % éch. 15/04/2029	3 000	1 877	0,06	6,750 % éch. 15/01/2030	2 500	2 130	0,07
Blue Racer Midstream LLC 7,625 % éch. 15/12/2025	5 000	5 059	0,17	Comstock Resources, Inc. 5,875 % éch. 15/01/2030	2 000	1 739	0,06	4,000 % éch. 31/07/2029	5 000	4 241	0,14
Boxer Parent Co., Inc. 6,500 % éch. 02/10/2025	€ 3 000	3 239	0,11	6,750 % éch. 01/03/2029	4 000	3 664	0,12	Ford Motor Co. 3,250 % éch. 12/02/2032	6 125	4 824	0,16
Boyd Gaming Corp. 4,750 % éch. 01/12/2027	\$ 2 000	1 897	0,06	CoreLogic, Inc. 4,500 % éch. 01/05/2028	7 000	5 651	0,18	6,100 % éch. 19/08/2032	4 250	4 123	0,13
4,750 % éch. 15/06/2031	4 000	3 578	0,12	Coty, Inc. 3,875 % éch. 15/04/2026	€ 7 750	8 216	0,27	Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % éch. 10/08/2026	8 000	7 150	0,23
Boyne USA, Inc. 4,750 % éch. 15/05/2029	5 000	4 510	0,15	5,000 % éch. 15/04/2026	\$ 1 000	959	0,03	2,900 % éch. 16/02/2028	5 000	4 287	0,14
Buckeye Partners LP 4,125 % éch. 01/03/2025	3 000	2 857	0,09	Covanta Holding Corp. 4,875 % éch. 01/12/2029	3 000	2 599	0,09	2,900 % éch. 10/02/2029	4 000	3 314	0,11
4,500 % éch. 01/03/2028	2 500	2 242	0,07	5,000 % éch. 01/09/2030	3 000	2 551	0,08	3,375 % éch. 13/11/2025	5 000	4 654	0,15
Builders FirstSource, Inc. 4,250 % éch. 01/02/2032	3 000	2 614	0,09	Credit Suisse AG AT1 Claim ^	4 900	196	0,01	4,000 % éch. 13/11/2030	12 000	10 266	0,33
5,000 % éch. 01/03/2030	5 000	4 680	0,15	Crestwood Midstream Partners LP 7,375 % éch. 01/02/2031	4 000	3 947	0,13	4,125 % éch. 17/08/2027	5 000	4 570	0,15
Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % éch. 01/07/2031	5 650	5 622	0,18	Cross, Inc. 4,125 % éch. 15/08/2031	4 000	3 236	0,11	4,134 % éch. 04/08/2025	6 000	5 696	0,19
Caesars Entertainment, Inc. 4,625 % éch. 15/10/2029	5 925	5 179	0,17	Crown Americas LLC 4,250 % éch. 30/09/2026	5 000	4 739	0,15	4,174 % éch. 01/12/2024	€ 5 000	5 390	0,18
6,250 % éch. 01/07/2025	5 000	4 981	0,16	4,750 % éch. 01/02/2026	2 000	1 940	0,06	4,542 % éch. 01/08/2026	\$ 3 000	2 823	0,09
7,000 % éch. 15/02/2030	5 000	5 026	0,16	CrownRock LP 5,000 % éch. 01/05/2029	2 000	1 876	0,06	6,950 % éch. 10/06/2026	5 000	5 030	0,16
Callon Petroleum Co. 7,500 % éch. 15/06/2030	3 000	2 834	0,09	5,625 % éch. 15/10/2025	5 000	4 932	0,16	7,200 % éch. 10/06/2030	5 000	5 051	0,16
Calpine Corp. 3,750 % éch. 01/03/2031	2 000	1 622	0,05	CSC Holdings LLC 3,375 % éch. 15/02/2031	5 000	3 389	0,11	Fortrea Holdings, Inc. 7,500 % éch. 01/07/2030	2 000	2 050	0,07
4,500 % éch. 15/02/2028	4 000	3 625	0,12	4,125 % éch. 01/12/2030	5 000	3 502	0,11	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 5,500 % éch. 01/05/2028	2 950	2 703	0,09
4,625 % éch. 01/02/2029	1 500	1 267	0,04	5,500 % éch. 15/04/2027	2 000	1 667	0,05	6,500 % éch. 01/10/2025	1 287	1 269	0,04
5,125 % éch. 15/03/2028	4 000	3 575	0,12	Curo Group Holdings Corp. 7,500 % éch. 01/08/2028	2 600	985	0,03	Frontier Communications Holdings LLC 5,000 % éch. 01/05/2028	2 500	2 159	0,07
5,250 % éch. 01/06/2026	663	641	0,02	4,250 % éch. 15/02/2031	5 000	3 389	0,11	5,875 % éch. 15/10/2027	3 000	2 756	0,09
Capstone Borrower, Inc. 8,000 % éch. 15/06/2030	3 100	3 064	0,10	4,125 % éch. 01/12/2030	5 000	3 502	0,11	6,750 % éch. 01/05/2029	3 000	2 330	0,08
Catalent Pharma Solutions, Inc. 2,375 % éch. 01/03/2028	€ 20 000	17 658	0,58	Diamond Offshore Drilling, Inc. 13,000 % éch. 21/12/2026	44	43	0,00	Gap, Inc. 3,625 % éch. 01/10/2029	3 500	2 477	0,08
5,000 % éch. 15/07/2027	\$ 1 000	919	0,03	Diamond Sports Group LLC 5,375 % éch. 15/08/2026 ^	6 000	206	0,01	3,875 % éch. 01/10/2031	4 000	2 743	0,09
CCO Holdings LLC 4,250 % éch. 01/02/2031	5 000	4 049	0,13	Directv Financing LLC 5,875 % éch. 15/08/2027	12 500	11 335	0,37	Gartner, Inc. 3,625 % éch. 15/06/2029	4 000	3 525	0,12
4,250 % éch. 15/01/2034	7 000	5 298	0,17	DISH DBS Corp. 5,250 % éch. 01/12/2026	6 750	5 427	0,18	3,750 % éch. 01/10/2030	2 000	1 744	0,06
4,500 % éch. 15/08/2030	10 000	8 336	0,27	5,750 % éch. 01/12/2028	5 000	3 728	0,12	4,500 % éch. 01/07/2028	2 000	1 870	0,06
4,500 % éch. 01/05/2032	10 000	7 994	0,26	5,875 % éch. 15/11/2024	5 000	4 379	0,14	Genesis Energy LP 6,250 % éch. 15/05/2026	2 000	1 902	0,06
4,500 % éch. 01/06/2033	5 000	3 932	0,13	7,750 % éch. 01/07/2026	5 000	3 072	0,10	6,500 % éch. 01/10/2025	2 000	1 972	0,06
4,750 % éch. 01/03/2030	7 000	5 992	0,20	DISH Network Corp. 11,750 % éch. 15/11/2027	5 000	4 885	0,16	8,875 % éch. 15/04/2030	700	685	0,02
5,125 % éch. 01/05/2027	9 000	8 390	0,27	DT Midstream, Inc. 4,125 % éch. 15/06/2029	5 000	4 393	0,14	Go Daddy Operating Co. LLC 3,500 % éch. 01/03/2029	5 000	4 289	0,14
5,375 % éch. 01/06/2029	3 500	3 168	0,10	4,375 % éch. 15/06/2031	4 000	3 451	0,11	GoTo Group, Inc. 5,500 % éch. 01/09/2027	2 000	1 103	0,04
CDI Escrow Issuer, Inc. 5,750 % éch. 01/04/2030	3 750	3 494	0,11	Edgewell Personal Care Co. 4,125 % éch. 01/04/2029	4 000	3 495	0,11	Graphic Packaging International LLC 2,625 % éch. 01/02/2029	€ 1 000	963	0,03
Central Garden & Pet Co. 4,125 % éch. 30/04/2031	4 000	3 303	0,11	5,500 % éch. 01/06/2028	5 000	4 732	0,15	3,500 % éch. 01/03/2029	\$ 2 500	2 189	0,07
Charles River Laboratories International, Inc. 3,750 % éch. 15/03/2029	2 000	1 762	0,06	Elanco Animal Health, Inc. 6,650 % éch. 28/08/2028	5 000	4 864	0,16	Greystar Real Estate Partners LLC 5,750 % éch. 01/12/2025	6 000	5 864	0,19
4,000 % éch. 15/03/2031	1 000	870	0,03	Element Solutions, Inc. 3,875 % éch. 01/09/2028	5 000	4 367	0,14	HAT Holdings LLC 3,375 % éch. 15/06/2026	5 400	4 845	0,16
Chesapeake Energy Corp. 5,500 % éch. 01/02/2026	2 000	1 952	0,06	Emerald Debt Merger Sub LLC 6,625 % éch. 15/12/2030	6 425	6 377	0,21	3,750 % éch. 15/09/2030	4 300	3 378	0,11
5,875 % éch. 01/02/2029	1 500	1 426	0,05	Encino Acquisition Partners Holdings LLC 8,500 % éch. 01/05/2028	2 184	1 984	0,06	HealthEquity, Inc. 4,500 % éch. 01/10/2029	2 000	1 765	0,06
6,750 % éch. 15/04/2029	12 000	11 918	0,39	Endeavor Energy Resources LP 5,750 % éch. 30/01/2028	10 000	9 791	0,32	Hertz Corp. 4,625 % éch. 01/12/2026	1 000	903	0,03
Churchill Downs, Inc. 6,750 % éch. 01/05/2031	5 000	4 950	0,16	EnLink Midstream LLC 5,375 % éch. 01/06/2029	7 500	7 152	0,23	5,000 % éch. 01/12/2029	3 000	2 484	0,08
Clarivate Science Holdings Corp. 3,875 % éch. 01/07/2028	3 750	3 328	0,11	5,625 % éch. 15/01/2028	1 000	969	0,03	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % éch. 15/02/2032	2 000	1 669	0,05
4,875 % éch. 01/07/2029	4 000	3 553	0,12	6,500 % éch. 01/09/2030	1 750	1 750	0,06	3,750 % éch. 01/05/2029	3 500	3 110	0,10
Clearway Energy Operating LLC 3,750 % éch. 15/01/2032	5 000	4 078	0,13	EnLogic, Inc. 4,500 % éch. 01/05/2028	7 000	5 651	0,18	4,000 % éch. 01/05/2031	3 000	2 608	0,09
4,750 % éch. 15/03/2028	2 000	1 847	0,06	EQM Midstream Partners LP 4,000 % éch. 01/08/2024	\$ 1 871	\$ 1 832	0,06	5,750 % éch. 01/05/2028	1 500	1 478	0,05
Cloud Software Group, Inc. 6,500 % éch. 31/03/2029	8 000	7 131	0,23	Fertitta Entertainment LLC 4,625 % éch. 15/01/2029	2 000	1 757	0,06	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 4,875 % éch. 01/07/2031	5 000	4 200	0,14
				First Student Bidco, Inc. 4,000 % éch. 31/07/2029	5 000	4 241	0,14	5,000 % éch. 01/06/2029	4 000	3 554	0,12
				Ford Motor Co. 3,250 % éch. 12/02/2032	6 125	4 824	0,16	Hilton Worldwide Finance LLC 4,875 % éch. 01/04/2027	2 500	2 427	0,08
				6,100 % éch. 19/08/2032	4 250	4 123	0,13	Hologic, Inc. 3,250 % éch. 15/02/2029	4 000	3 503	0,11
				Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % éch. 10/08/2026	8 000	7 150	0,23	4,625 % éch. 01/02/2028	5 000	4 716	0,15
				2,900 % éch. 16/02/2028	5 000	4 287	0,14				
				2,900 % éch. 10/02/2029	4 000	3 314	0,11				
				3,375 % éch. 13/11/2025	5 000	4 654	0,15				
				4,000 % éch. 13/11/2030	12 000	10 266	0,33				
				4,125 % éch. 17/08/2027	5 000	4 570	0,15				
				4,134 % éch. 04/08/2025	6 000	5 696	0,19				
				4,174 % éch. 01/12/2024	€ 5 000	5 390	0,18				
				4,542 % éch. 01/08/2026	\$ 3 000	2 823	0,09				
				6,950 % éch. 10/06/2026	5 000	5 030	0,16				
				7,200 % éch. 10/06/2030	5 000	5 051	0,16				
				Fortrea Holdings, Inc. 7,500 % éch. 01/07/2030	2 000	2 050	0,07				
				Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 5,500 % éch. 01/05/2028	2 950	2 703	0,09				
				6,500 % éch. 01/10/2025	1 287	1 269					

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET
Howard Hughes Corp.				MPH Acquisition Holdings LLC				PennyMac Financial Services, Inc.			
4,125 % éch. 01/02/2029	\$ 4 000	\$ 3 314	0,11	5,500 % éch. 01/09/2028	\$ 5 000	\$ 4 268	0,14	4,250 % éch. 15/02/2029	\$ 7 500	\$ 6 031	0,20
4,375 % éch. 01/02/2031	3 000	2 397	0,08	5,750 % éch. 01/11/2028	5 000	3 769	0,12	5,750 % éch. 15/09/2031	2 000	1 633	0,05
5,375 % éch. 01/08/2028	1 000	891	0,03	MPT Operating Partnership LP				Performance Food Group, Inc.			
Howard Midstream Energy Partners LLC				0,993 % éch. 15/10/2026	€ 3 300	2 739	0,09	4,250 % éch. 01/08/2029	3 000	2 674	0,09
6,750 % éch. 15/01/2027	450	429	0,01	2,500 % éch. 24/03/2026	£ 2 125	2 122	0,07	5,500 % éch. 15/10/2027	5 000	4 825	0,16
8,875 % éch. 15/07/2028 (a)	5 775	5 811	0,19	Nabors Industries, Inc.				6,875 % éch. 01/05/2025	1 500	1 503	0,05
Howmet Aerospace, Inc.				7,375 % éch. 15/05/2027	\$ 2 750	2 619	0,09	Permian Resources Operating LLC			
5,950 % éch. 01/02/2037	3 000	3 058	0,10	Nationstar Mortgage Holdings, Inc.				5,375 % éch. 15/01/2026	2 000	1 907	0,06
iHeartCommunications, Inc.				5,500 % éch. 15/08/2028	5 000	4 386	0,14	5,875 % éch. 01/07/2029	3 000	2 829	0,09
4,750 % éch. 15/01/2028	5 000	3 776	0,12	NCR Corp.				6,875 % éch. 01/04/2027	4 000	3 957	0,13
5,250 % éch. 15/08/2027	3 000	2 298	0,08	5,000 % éch. 01/10/2028	4 000	3 574	0,12	PetSmart, Inc.			
Imola Merger Corp.				5,250 % éch. 01/10/2030	2 500	2 177	0,07	4,750 % éch. 15/02/2028	12 000	11 103	0,36
4,750 % éch. 15/05/2029	7 500	6 530	0,21	5,750 % éch. 01/09/2027	3 750	3 754	0,12	7,750 % éch. 15/02/2029	6 000	5 968	0,19
IQVIA, Inc.				6,125 % éch. 01/09/2029	2 000	2 003	0,07	Post Holdings, Inc.			
2,250 % éch. 15/01/2028	€ 10 000	9 653	0,31	Newell Brands, Inc.				4,500 % éch. 15/09/2031	1 864	1 594	0,05
2,250 % éch. 15/03/2029	5 900	5 515	0,18	5,875 % éch. 01/04/2036	1 525	1 277	0,04	4,625 % éch. 15/04/2030	5 000	4 387	0,14
2,875 % éch. 15/06/2028	7 000	6 898	0,23	6,375 % éch. 15/09/2027	1 250	1 200	0,04	5,500 % éch. 15/12/2029	5 000	4 620	0,15
5,000 % éch. 15/05/2027	\$ 2 000	1 926	0,06	Nexstar Media, Inc.				5,625 % éch. 15/01/2028	5 000	4 812	0,16
Jeld-Wen, Inc.				4,750 % éch. 01/11/2028	4 000	3 475	0,11	Prime Security Services Borrower LLC			
4,625 % éch. 15/12/2025	1 000	970	0,03	5,625 % éch. 15/07/2027	4 000	3 732	0,12	3,375 % éch. 31/08/2027	5 000	4 415	0,14
4,875 % éch. 15/12/2027	2 000	1 774	0,06	NextEra Energy Operating Partners LP				5,250 % éch. 15/04/2024	1 600	1 588	0,05
6,250 % éch. 15/05/2025	2 000	2 019	0,07	4,250 % éch. 15/07/2024	2 000	1 958	0,06	5,750 % éch. 15/04/2026	4 000	3 930	0,13
Kaiser Aluminum Corp.				4,250 % éch. 15/09/2024	262	251	0,01	6,250 % éch. 15/01/2028	5 000	4 691	0,15
4,500 % éch. 01/06/2031	2 000	1 597	0,05	4,500 % éch. 15/09/2027	3 000	2 790	0,09	Radiate Holdco LLC			
4,625 % éch. 01/03/2028	4 000	3 504	0,11	NGL Energy Operating LLC				4,500 % éch. 15/09/2026	6 000	4 792	0,16
KFC Holding Co.				7,500 % éch. 01/02/2026	4 500	4 437	0,14	6,500 % éch. 15/09/2028	3 000	1 755	0,06
4,750 % éch. 01/06/2027	3 500	3 382	0,11	Noble Finance LLC				Range Resources Corp.			
Kinetik Holdings LP				8,000 % éch. 15/04/2030	4 300	4 376	0,14	4,750 % éch. 15/02/2030	2 000	1 795	0,06
5,875 % éch. 15/06/2030	3 000	2 854	0,09	Novelis Corp.				8,250 % éch. 15/01/2029	2 000	2 084	0,07
Kronos International, Inc.				3,250 % éch. 15/11/2026	3 000	2 719	0,09	RHP Hotel Properties LP			
3,750 % éch. 15/09/2025	€ 8 200	8 185	0,27	3,875 % éch. 15/08/2031	8 000	6 592	0,22	4,500 % éch. 15/02/2029	7 500	6 644	0,22
LABL, Inc.				4,750 % éch. 15/07/2027	7 000	6 228	0,20	4,750 % éch. 15/10/2027	4 000	3 729	0,12
5,875 % éch. 01/11/2028	\$ 2 500	2 278	0,07	NRG Energy, Inc.				Ritchie Bros Holdings, Inc.			
6,750 % éch. 15/07/2026	5 000	4 921	0,16	3,375 % éch. 15/02/2029	4 250	3 480	0,11	6,750 % éch. 15/03/2028	1 400	1 413	0,05
Lamb Weston Holdings, Inc.				6,625 % éch. 15/01/2027	1 067	1 060	0,03	7,750 % éch. 15/03/2031	2 500	2 597	0,08
4,125 % éch. 31/01/2030	2 000	1 789	0,06	NSG Holdings LLC				RLJ Lodging Trust LP			
4,875 % éch. 15/05/2028	2 000	1 917	0,06	7,750 % éch. 15/12/2025	482	480	0,02	4,000 % éch. 15/09/2029	5 000	4 192	0,14
Legacy LifePoint Health LLC				NuStar Logistics LP				Rockcliff Energy LLC			
4,375 % éch. 15/02/2027	4 000	3 100	0,10	5,750 % éch. 01/10/2025	2 500	2 440	0,08	5,500 % éch. 15/10/2029	5 000	4 617	0,15
Legends Hospitality Holding Co. LLC				6,375 % éch. 01/10/2030	2 000	1 910	0,06	Rocket Mortgage LLC			
5,000 % éch. 01/02/2026	1 750	1 577	0,05	Olympus Water U.S. Holding Corp.				3,625 % éch. 01/03/2029	1 750	1 473	0,05
Lehman Brothers Holdings, Inc.				3,875 % éch. 01/10/2028	€ 10 000	8 637	0,28	3,875 % éch. 01/03/2031	3 000	2 435	0,08
0,000 % éch. 25/05/2010 ^	14 200	32	0,00	4,250 % éch. 01/10/2028	\$ 2 000	1 583	0,05	4,000 % éch. 15/10/2033	2 000	1 566	0,05
Level 3 Financing, Inc.				5,375 % éch. 01/10/2029 (i)	€ 10 000	7 644	0,25	Rockies Express Pipeline LLC			
3,625 % éch. 15/01/2029	2 000	1 202	0,04	ON Semiconductor Corp.				3,600 % éch. 15/05/2025	1 500	1 419	0,05
3,750 % éch. 15/07/2029	3 000	1 810	0,06	3,875 % éch. 01/09/2028	\$ 3 500	3 189	0,10	4,800 % éch. 15/05/2030	2 000	1 750	0,06
4,250 % éch. 01/07/2028	5 000	3 225	0,11	OneMain Finance Corp.				4,950 % éch. 15/07/2029	4 000	3 664	0,12
LFS Topco LLC				3,500 % éch. 15/01/2027	5 000	4 295	0,14	Sabre GLBL, Inc.			
5,875 % éch. 15/10/2026	2 500	2 199	0,07	5,375 % éch. 15/11/2029	5 000	4 256	0,14	7,375 % éch. 01/09/2025	2 000	1 778	0,06
Lindblad Expeditions LLC				6,125 % éch. 15/03/2024	3 000	2 992	0,10	11,250 % éch. 15/12/2027	2 280	1 934	0,06
6,750 % éch. 15/02/2027	2 800	2 670	0,09	6,625 % éch. 15/01/2028	2 000	1 889	0,06	SBA Communications Corp.			
Live Nation Entertainment, Inc.				6,875 % éch. 15/03/2025	5 000	4 955	0,16	3,125 % éch. 01/02/2029	7 000	5 940	0,19
6,500 % éch. 15/05/2027	4 000	4 025	0,13	7,125 % éch. 15/03/2026	2 000	1 967	0,06	3,875 % éch. 15/02/2027	7 000	6 455	0,21
Madison IAQ LLC				Organon & Co.				SCIH Salt Holdings, Inc.			
4,125 % éch. 30/06/2028	8 000	7 052	0,23	2,875 % éch. 30/04/2028	€ 7 500	7 122	0,23	4,875 % éch. 01/05/2028	5 000	4 472	0,15
Marriott Ownership Resorts, Inc.				4,125 % éch. 30/04/2028	\$ 3 000	2 666	0,09	6,625 % éch. 01/05/2029	3 000	2 517	0,08
4,500 % éch. 15/06/2029	2 000	1 728	0,06	5,125 % éch. 30/04/2031	6 000	4 958	0,16	SCIL LLC			
Mattel, Inc.				Outfront Media Capital LLC				9,500 % éch. 15/07/2028 (a)	€ 2 475	2 700	0,09
3,750 % éch. 01/04/2029	3 000	2 642	0,09	4,250 % éch. 15/01/2029	2 500	2 104	0,07	Scripps Escrow, Inc.			
5,875 % éch. 15/12/2027	5 000	4 915	0,16	4,625 % éch. 15/03/2030	2 000	1 669	0,05	5,875 % éch. 15/07/2027	\$ 5 000	4 054	0,13
Mauser Packaging Solutions Holding Co.				5,000 % éch. 15/08/2027	3 000	2 727	0,09	Select Medical Corp.			
7,875 % éch. 15/08/2026	6 000	5 968	0,19	6,250 % éch. 15/06/2025	2 000	1 995	0,07	6,250 % éch. 15/08/2026	2 000	1 968	0,06
Medline Borrower LP				Owens & Minor, Inc.				Sensata Technologies, Inc.			
3,875 % éch. 01/04/2029	13 500	11 745	0,38	6,625 % éch. 01/04/2030	3 750	3 406	0,11	3,750 % éch. 15/02/2031	6 000	5 138	0,17
5,250 % éch. 01/10/2029	18 500	16 071	0,52	Owens-Brockway Glass Container, Inc.				Silgan Holdings, Inc.			
MGM Resorts International				7,250 % éch. 15/05/2031	2 400	2 433	0,08	2,250 % éch. 01/06/2028	€ 5 750	5 417	0,18
4,625 % éch. 01/09/2026	5 000	4 720	0,15	Oxford Finance LLC				Sirius XM Radio, Inc.			
5,750 % éch. 15/06/2025	1 000	992	0,03	6,375 % éch. 01/02/2027	5 300	4 937	0,16	3,875 % éch. 01/09/2031	\$ 2 000	1 548	0,05
Michaels Cos., Inc.				4,375 % éch. 15/10/2028	3 000	2 601	0,08	4,000 % éch. 15/07/2028	8 000	6 960	0,23
5,250 % éch. 01/05/2028	3 750	3 034	0,10	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC				5,000 % éch. 01/08/2027	5 000	4 644	0,15
Midcap Financial Issuer Trust				Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.				SM Energy Co.			
6,500 % éch. 01/05/2028	4 000	3 565	0,12	4,000 % éch. 15/10/2027	10 000	8 855	0,29	6,500 % éch. 15/07/2028	2 000	1 922	0,06
Midwest Gaming Borrower LLC				Park Intermediate Holdings LLC				6,625 % éch. 15/01/2027	2 000	1 944	0,06
4,875 % éch. 01/05/2029	6 000	5 304	0,17	4,875 % éch. 15/05/2029	3 000	2 588	0,08	Southwestern Energy Co.			
Moog, Inc.				7,500 % éch. 01/06/2025	1 000	1 001	0,03	5,375 % éch. 01/02/2029	5 000	4 713	0,15
4,250 % éch. 15/12/2027	4 000	3 705	0,12	PDC Energy, Inc.				5,375 % éch. 15/03/2030	5 000	4 671	0,15

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 septembre	Court	09/2023	1 726	\$ 2 312	0,08
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	816	(1 112)	(0,04)
				\$ 1 200	0,04
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ 1 200	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
Newell Brands, Inc.	1,000 %	20/06/2028	\$ 2 400	\$ 20	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-40 à 5 ans	5,000 %	20/06/2028	\$ 22 200	\$ 720	0,02
Total des Instruments financiers dérivés compensés				\$ 740	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
JLN	Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20/06/2028	€ 200	\$ 30	\$ 2	\$ 32	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	07/2023	€ 4 885	\$ 5 292	\$ 2	\$ (39)	\$ (37)	0,00
BPS	07/2023	767 233	824 859	2	(12 196)	(12 194)	(0,40)
	07/2023	\$ 3 569	€ 3 267	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07/2023	€ 8 759	\$ 9 468	8	(96)	(88)	0,00
	07/2023	\$ 5 166	€ 4 770	38	0	38	0,00
	08/2023	CAD 861	\$ 646	0	(5)	(5)	0,00
JPM	07/2023	£ 145	184	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 835 611	€ 765 282	0	(688)	(688)	(0,02)
	08/2023	CAD 1 416	\$ 1 059	0	(12)	(12)	0,00
	08/2023	€ 765 282	836 780	715	0	715	0,02
	08/2023	\$ 184	£ 145	1	0	1	0,00
MBC	07/2023	€ 7 738	\$ 8 414	24	(52)	(28)	0,00
	07/2023	£ 47 813	59 186	0	(1 601)	(1 601)	(0,05)
	07/2023	\$ 11 435	€ 10 595	124	0	124	0,00
MYI	07/2023	€ 58	\$ 63	0	0	0	0,00
	07/2023	£ 396	498	0	(6)	(6)	0,00

Tableau des investissements Fonds Global High Yield 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
	07/2023	\$ 2 624	€ 2 451	\$ 50	\$ 0	\$ 50	0,00
	07/2023	\$ 5 438	€ 4 309	41	0	41	0,00
TOR	07/2023	60 934	47 953	31	0	31	0,00
	08/2023	£ 47 953	\$ 60 948	0	(30)	(30)	0,00
				\$ 1 036	\$ (14 731)	\$ (13 695)	(0,45)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BPS	07/2023	CHF 8 275	\$ 9 253	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07/2023	\$ 12 169	CHF 11 009	136	0	136	0,01
	08/2023	9 253	8 252	0	(3)	(3)	0,00
CLY	07/2023	CHF 4 374	\$ 4 869	0	(20)	(20)	0,00
	08/2023	\$ 4 869	CHF 4 361	20	0	20	0,00
MBC	07/2023	CHF 358	\$ 399	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$ 116	CHF 105	2	0	2	0,00
MYI	07/2023	CHF 93	\$ 103	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 33	CHF 30	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	8 935	8 028	39	0	39	0,00
UAG	07/2023	CHF 8 544	\$ 9 531	0	(19)	(19)	0,00
	07/2023	\$ 8 052	CHF 7 235	35	0	35	0,00
	08/2023	9 531	8 520	19	0	19	0,00
				\$ 254	\$ (45)	\$ 209	0,01

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 437	\$ 473	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07/2023	\$ 392 875	€ 365 549	5 943	(2)	5 941	0,19
BPS	07/2023	€ 377 818	\$ 414 037	1 840	(3)	1 837	0,06
	07/2023	\$ 393 164	€ 365 704	5 821	(2)	5 819	0,19
	08/2023	397 293	362 084	0	(1 719)	(1 719)	(0,05)
CBK	07/2023	€ 364 241	\$ 395 945	2	(1 444)	(1 442)	(0,05)
	07/2023	\$ 293	€ 270	2	0	2	0,00
	08/2023	389 917	358 138	1 347	0	1 347	0,04
JPM	07/2023	€ 362 629	\$ 395 955	326	0	326	0,01
	07/2023	\$ 9 812	€ 9 177	200	0	200	0,01
	08/2023	396 508	362 629	0	(338)	(338)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 1 676	\$ 1 796	1	(33)	(32)	0,00
	07/2023	\$ 2 211	€ 2 060	37	0	37	0,00
SOG	07/2023	391 584	364 014	5 555	0	5 555	0,18
				\$ 21 074	\$ (3 545)	\$ 17 529	0,57

Au 30 juin 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	07/2023	£ 895	\$ 1 127	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
	07/2023	\$ 671	£ 528	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	£ 49	\$ 61	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$ 135 368	£ 109 441	3 771	0	3 771	0,12
BRC	07/2023	£ 787	\$ 980	0	(21)	(21)	0,00
	07/2023	\$ 3 592	£ 2 822	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07/2023	£ 7 257	\$ 9 202	4	(29)	(25)	0,00
	07/2023	\$ 594	£ 467	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07/2023	£ 107 650	\$ 136 113	0	(748)	(748)	(0,02)
	08/2023	\$ 136 142	£ 107 650	747	0	747	0,02
MBC	07/2023	\$ 135 292	£ 109 288	3 651	0	3 651	0,12
MYI	07/2023	£ 363	\$ 450	0	(12)	(12)	0,00
	07/2023	\$ 135 000	£ 108 620	3 095	0	3 095	0,10
SCX	07/2023	£ 244	\$ 304	0	(7)	(7)	0,00
TOR	07/2023	108 645	138 055	0	(71)	(71)	0,00
	08/2023	\$ 138 085	£ 108 645	68	0	68	0,00
				\$ 11 336	\$ (905)	\$ 10 431	0,34

Au 30 juin 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
BRC	07/2023	\$ 1 662	SGD 2 249	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	07/2023	SGD 29	\$ 22	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 119	SGD 160	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	SGD 16	\$ 12	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 1 519	SGD 2 052	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023	13	18	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	SGD 2 426	\$ 1 795	3	0	3	0,00
	07/2023	\$ 1	SGD 2	0	0	0	0,00
	08/2023	1 758	2 373	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07/2023	201	272	0	0	0	0,00
UAG	07/2023	2 031	2 748	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 3	\$ (7)	\$ (4)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ 14 502	0,47
Total des Investissements						\$ 3 064 337	99,82
Autres actifs et passifs à court terme						\$ 5 499	0,18
Actifs nets						\$ 3 069 836	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 : 0,00 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature)	9,000 %	22/04/2027	12/05/2021	\$ 66	\$ 64	0,00

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 11 629 \$ (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 30 juin 2023.

(j) Un titre d'une juste valeur globale de 49 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 2 600 \$ (31 décembre 2022 : 8 590 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 12 259 \$ (31 décembre 2022 : 20 021 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 0 \$ (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 30 juin 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 30 juin 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	\$ 2 912 555	\$ 608	\$ 2 913 163
Fonds d'investissement	130 837	0	0	130 837
Contrats de mise en pension	0	3 895	0	3 895
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	2 312	14 130	0	16 442
Totaux	\$ 133 149	\$ 2 930 580	\$ 608	\$ 3 064 337

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

Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

(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 30 juin 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	2,000 %	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (1 749)	\$ (1 913)	(0,06)
JML	2,500	06/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(2 528)	(2 762)	(0,09)
	2,500	08/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(2 124)	(2 321)	(0,08)
	2,500	12/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(1 273)	(1 390)	(0,05)
MYI	2,200	31/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(2 025)	(2 213)	(0,07)
	2,500	17/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(1 266)	(1 386)	(0,04)
Total des Contrats de prise en pension					\$ (11 985)	(0,39)

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 5 890	\$ (4 505)	\$ 1 385	\$ 1 580	\$ (1 340)	\$ 240
BPS	(2 357)	2 600	243	33	0	33
BRC	(25)	0	(25)	9	0	9
CBK	(174)	0	(174)	11 688	(11 530)	158
GLM	S/O	S/O	S/O	3	(10)	(7)
JLN	32	0	32	S/O	S/O	S/O
JPM	202	(270)	(68)	(416)	50	(366)
MBC	2 148	(1 630)	518	8 000	(7 460)	540
MYI	3 167	(2 240)	927	(51)	0	(51)
SCX	32	0	32	(9 114)	8 540	(574)
SOG	5 555	(4 100)	1 455	S/O	S/O	S/O
TOR	(2)	0	(2)	100	(180)	(80)
UAG	34	49	83	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	50,99	49,58
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	43,90	42,29
Autres valeurs mobilières	0,01	0,01
Fonds d'investissement	4,26	6,50
Contrats de mise en pension	0,13	0,37
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,04	0,03
Instruments financiers dérivés compensés	0,02	0,10
Instruments financiers dérivés hors cote	0,47	0,38
Contrats de prise en pension	(0,39)	(0,34)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Belgique	0,24	0,22
Bermudes	0,66	0,40
Canada	1,62	1,55
Îles Caïmans	0,62	0,78
République tchèque	0,71	S/O
Danemark	S/O	0,09
France	3,11	1,95
Allemagne	3,40	2,67
Irlande	0,24	0,22
Italie	4,20	3,75
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,12	0,20
Libéria	1,06	0,67
Luxembourg	3,27	2,47
Multinationales	2,03	1,67
Pays-Bas	4,64	5,00
Norvège	0,33	0,34
Panama	0,66	0,53
Espagne	2,21	1,70
Suède	0,89	0,91

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Suisse	S/O	0,11
Royaume-Uni	4,18	3,84
États-Unis	58,18	59,77
Instruments à court terme	2,53	3,04
Fonds d'investissement	4,26	6,50
Contrats de mise en pension	0,13	0,37
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,04	0,03
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,02	0,10
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	(0,45)	(0,64)
Contrats de change à terme couverts	0,92	1,02
Autres actifs et passifs à court terme	0,18	0,74
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund

DESCRIPTION VALEURS MOBILIÈRES	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AUSTRALIE				BRESIL				CHILI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Boral Finance Pty. Ltd. 3,750 % éch. 01/05/2028	\$ 415	\$ 371	0,00	Viking Cruises Ltd. 13,000 % éch. 15/05/2025	4 300	4 518	0,04	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % éch. 18/11/2027	14 256	12 035	0,12
CIMIC Finance Ltd. 1,500 % éch. 28/05/2029	€ 4 300	3 688	0,04	Total Bermudes		52 283	0,50	2,875 % éch. 15/02/2025	8 300	7 723	0,07
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd. 1,900 % éch. 14/12/2028	AUD 23 500	12 697	0,12			59 532	0,57	4,250 % éch. 15/04/2026	3 600	3 356	0,03
GTA Finance Co. Pty. Ltd. 2,200 % éch. 26/08/2027	7 200	4 123	0,04					4,375 % éch. 01/05/2026	2 310	2 160	0,02
Lendlease Finance Ltd. 3,400 % éch. 27/10/2027	9 900	5 786	0,06					5,500 % éch. 15/01/2026	18 600	18 032	0,17
Macquarie University 3,500 % éch. 07/09/2028	250	153	0,00					China Modern Dairy Holdings Ltd. 2,125 % éch. 14/07/2026	9 400	8 054	0,08
Network Finance Co. Pty. Ltd. 6,061 % éch. 19/08/2030	700	467	0,00					Gaci First Investment Co. 4,750 % éch. 14/02/2030	2 600	2 562	0,03
Optus Finance Pty. Ltd. 1,000 % éch. 20/06/2029	€ 6 800	6 098	0,06					4,875 % éch. 14/02/2035	1 900	1 824	0,02
Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % éch. 22/03/2028	\$ 15 900	14 459	0,14					5,125 % éch. 14/02/2053	13 000	11 716	0,11
Qantas Airways Ltd. 3,150 % éch. 27/09/2028	AUD 500	288	0,00					Goodman HK Finance 4,375 % éch. 19/06/2024	3 500	3 437	0,03
Santos Finance Ltd. 4,125 % éch. 14/09/2027	\$ 7 800	7 194	0,07					Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % éch. 06/06/2025	16 760	15 984	0,15
5,250 % éch. 13/03/2029	21 600	20 330	0,19					5,250 % éch. 26/04/2026	3 650	3 382	0,03
Woodside Finance Ltd. 3,700 % éch. 15/03/2028	600	553	0,01					5,375 % éch. 04/12/2029	3 027	2 515	0,02
4,500 % éch. 04/03/2029	26 390	24 904	0,24					5,625 % éch. 17/07/2027	8 655	7 849	0,08
		101 111	0,97					5,750 % éch. 21/07/2028	2 100	1 859	0,02
ÉMISSIONS SOUVERAINES								MGM China Holdings Ltd. 5,250 % éch. 18/06/2025	8 300	7 966	0,08
Obligation internationale du gouvernement australien 1,000 % éch. 21/11/2031	AUD 51 800	27 144	0,26					5,375 % éch. 15/05/2024	1 255	1 237	0,01
1,250 % éch. 21/05/2032	24 000	12 698	0,12					5,875 % éch. 15/05/2026	6 746	6 434	0,06
4,500 % éch. 21/04/2033	59 700	41 258	0,39					Sands China Ltd. 2,800 % éch. 08/03/2027	1 000	869	0,01
		81 100	0,77					3,350 % éch. 08/03/2029	1 500	1 251	0,01
Total Australie		182 211	1,74					4,300 % éch. 08/01/2026	3 900	3 670	0,04
AUTRICHE								5,900 % éch. 08/08/2028	14 348	13 690	0,13
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS								Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 5,950 % éch. 17/07/2026	10 700	10 684	0,10
Erste Group Bank AG 4,250 % éch. 15/10/2027 (g)(i)	€ 17 800	14 812	0,14					Tencent Holdings Ltd. 2,390 % éch. 03/06/2030	11 900	9 893	0,10
5,125 % éch. 15/10/2025 (g)(i)	5 600	5 425	0,05					3,240 % éch. 03/06/2050	5 200	3 416	0,03
Total Autriche		20 237	0,19					3,290 % éch. 03/06/2060	700	435	0,00
BELGIQUE								3,975 % éch. 11/04/2029	32 750	30 464	0,29
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS								Tencent Music Entertainment Group 2,000 % éch. 03/09/2030	2 800	2 212	0,02
KBC Group NV 4,250 % éch. 24/10/2025 (g)(i)	5 000	4 717	0,04					Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1,625 % éch. 24/09/2025	11 500	10 466	0,10
Sofina S.A. 1,000 % éch. 23/09/2028	9 300	8 126	0,08					Wynn Macau Ltd. 4,875 % éch. 01/10/2024	4 635	4 524	0,04
Total Belgique		12 843	0,12					5,500 % éch. 15/01/2026	8 757	8 144	0,08
BERMUDES								5,500 % éch. 01/10/2027	2 000	1 782	0,02
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS								Xiaomi Best Time International Ltd. 2,875 % éch. 14/07/2031	1 900	1 437	0,01
MAPS Ltd. 4,212 % éch. 15/05/2043	\$ 5 281	4 718	0,05					Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % éch. 13/01/2026	7 100	6 476	0,06
START Ltd. 4,089 % éch. 15/03/2044	2 870	2 531	0,02						237 314	2,26	
		7 249	0,07					Total Îles Caïmans		254 339	2,42
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS								CHILI			
Aircastle Ltd. 2,850 % éch. 26/01/2028	6 400	5 450	0,05					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
4,250 % éch. 15/06/2026	3 050	2 875	0,03					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Arch Capital Group Ltd. 3,635 % éch. 30/06/2050	2 760	2 026	0,02					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Bacardi Ltd. 2,750 % éch. 15/07/2026	1 950	1 796	0,02					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
4,450 % éch. 15/05/2025	10 410	10 136	0,10					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
BERMUDES								CHINE			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS								OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd. 4,213 % éch. 16/12/2041	\$ 5 433	5 002	0,05					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
KDAC Aviation Finance Ltd. 4,212 % éch. 15/12/2042	3 991	3 319	0,03					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Sapphire Aviation Finance Ltd. 4,250 % éch. 15/03/2040	7 500	6 250	0,06					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd. 4,212 % éch. 17/05/2032	2 708	2 454	0,02					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
		17 025	0,16					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS								COLOMBIE			
Alibaba Group Holding Ltd. 2,125 % éch. 09/02/2031	4 100	3 341	0,03					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS								OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Atrium Finance PLC 2,625 % éch. 05/09/2027	€ 12 100	9 625	0,09					OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
REPUBLIQUE TCHÈQUE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
EP Infrastructure A/S 1,659 % éch. 26/04/2024	€ 5 500	\$ 5 721	0,05
DANEMARK			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
GN Store Nord A/S 0,875 % éch. 25/11/2024	13 800	14 046	0,13
Jyske Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053	DKK 8 757	966	0,01
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050	4 082	431	0,00
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	100 443	10 570	0,10
1,000 % éch. 01/10/2053	9 336	955	0,01
1,500 % éch. 01/10/2053	6 906	762	0,01
Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	33 917	3 573	0,04
1,000 % éch. 01/10/2053	3 671	356	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053	6 916	763	0,01
Total Danemark		32 422	0,31
FINLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Balder Finland Oyj 1,000 % éch. 20/01/2029	€ 14 100	9 820	0,09
Nokia Oyj 4,375 % éch. 12/06/2027	\$ 2 800	2 640	0,03
Nordea Bank Abp 3,750 % éch. 01/03/2029 (g)(i)	4 000	2 970	0,03
SATO Oyj 1,375 % éch. 24/02/2028	€ 6 671	5 506	0,05
Teollisuuden Voima Oyj 4,750 % éch. 01/06/2030	1 200	1 310	0,01
Total Finlande		22 246	0,21
FRANCE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Altarea S.C.A. 1,750 % éch. 16/01/2030	11 200	8 540	0,08
1,875 % éch. 17/01/2028	5 900	5 206	0,05
BNP Paribas S.A. 1,904 % éch. 30/09/2028	\$ 4 700	4 008	0,04
2,219 % éch. 09/06/2026	21 000	19 433	0,18
3,500 % éch. 16/11/2027	20 000	18 399	0,18
5,198 % éch. 10/01/2030	15 000	14 512	0,14
Bureau Veritas S.A. 1,250 % éch. 07/09/2023	€ 300	326	0,00
1,875 % éch. 06/01/2025	15 400	16 227	0,15
Crédit Agricole S.A. 5,301 % éch. 12/07/2028	\$ 900	898	0,01
Électricité de France S.A. 4,625 % éch. 25/01/2043	€ 2 100	2 200	0,02
5,625 % éch. 25/01/2053	£ 5 300	5 775	0,05
6,250 % éch. 23/05/2033	\$ 12 000	12 207	0,12
6,900 % éch. 23/05/2053	4 100	4 253	0,04
9,125 % éch. 15/03/2033 (g)	3 400	3 495	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,475 % éch. 18/01/2031	€ 9 200	8 202	0,08
1,625 % éch. 18/09/2029	3 700	3 451	0,03
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement 0,625 % éch. 16/09/2028	3 200	2 858	0,03
Indigo Group S.A.S. 1,625 % éch. 19/04/2028	9 800	9 427	0,09
New Immo Holding S.A. 2,750 % éch. 26/11/2026	2 800	2 739	0,03
Peugeot Invest 1,875 % éch. 30/10/2026	18 500	18 395	0,17
SEB S.A. 1,375 % éch. 16/06/2025	6 900	7 121	0,07
Société Générale S.A. 1,488 % éch. 14/12/2026	\$ 13 400	11 800	0,11

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
2,889 % éch. 09/06/2032	\$ 25 000	\$ 19 609	0,19
6,691 % éch. 10/01/2034	26 900	27 405	0,26
TDF Infrastructure SASU 1,750 % éch. 01/12/2029	€ 9 100	8 009	0,08
2,500 % éch. 07/04/2026	7 300	7 484	0,07
Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % éch. 24/11/2027	18 600	15 598	0,15
		257 577	2,45
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS			
Alice France S.A. 8,677 % éch. 15/08/2028	4 216	4 023	0,04
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 3,000 % éch. 25/11/2031	4 400	4 767	0,05
Total France		266 367	2,54
ALLEMAGNE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Bayer AG 0,625 % éch. 12/07/2031	1 000	839	0,01
Deutsche Bank AG 1,750 % éch. 19/11/2030	40 300	34 794	0,33
2,311 % éch. 16/11/2027	\$ 2 800	2 408	0,02
2,625 % éch. 16/12/2024	£ 15 000	17 750	0,17
3,547 % éch. 18/09/2031	\$ 12 643	10 507	0,10
3,961 % éch. 26/11/2025	600	572	0,01
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % éch. 09/07/2024	€ 9 200	9 776	0,10
1,875 % éch. 31/03/2028	8 700	8 396	0,08
2,125 % éch. 09/07/2027	14 700	14 730	0,14
Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % éch. 22/09/2026	100	91	0,00
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature) 3,750 % éch. 15/09/2026 (c)	19 800	20 209	0,19
Robert Bosch GmbH 3,625 % éch. 02/06/2030	2 000	2 164	0,02
4,000 % éch. 02/06/2035	2 200	2 438	0,02
4,375 % éch. 02/06/2043	300	336	0,00
Sixt SE 1,750 % éch. 09/12/2024	11 070	11 656	0,11
Volkswagen Bank GmbH 4,375 % éch. 03/05/2028	400	435	0,01
4,625 % éch. 03/05/2031	5 300	5 809	0,06
Volkswagen Leasing GmbH 1,500 % éch. 19/06/2026	7 500	7 544	0,07
Vonovia SE 0,250 % éch. 01/09/2028	8 900	7 560	0,07
		158 014	1,51
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
République d'Allemagne 1,300 % éch. 15/10/2027	5 100	5 266	0,05
Total Allemagne		163 280	1,56
GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Amdocs Ltd. 2,538 % éch. 15/06/2030	\$ 5 975	4 993	0,05
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % éch. 29/07/2026	€ 16 900	13 899	0,13
3,000 % éch. 29/03/2025	1 100	993	0,01
Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % éch. 22/06/2026	8 500	7 668	0,07
1,750 % éch. 24/11/2028	10 100	7 871	0,08
Total Guernesey, îles Anglo-normandes		35 424	0,34
HONG KONG			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AIA Group Ltd. 4,950 % éch. 04/04/2033	\$ 300	300	0,00
Lenovo Group Ltd. 3,421 % éch. 02/11/2030	6 400	5 398	0,05
		5 698	0,05

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Airport Authority Hong Kong 2,400 % éch. 08/03/2028 (g)	\$ 2 350	\$ 2 071	0,02
3,450 % éch. 21/02/2029	5 500	5 103	0,05
		7 174	0,07
Total Hong Kong		12 872	0,12
INDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Adani Transmission Step-One Ltd. 4,250 % éch. 21/05/2036	17 033	12 896	0,12
Bharti Airtel Ltd. 4,375 % éch. 10/06/2025	5 000	4 862	0,05
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027	4 978	4 667	0,04
Total Inde		22 425	0,21
INDONÉSIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT 4,625 % éch. 20/07/2023	2 900	2 899	0,03
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,800 % éch. 23/06/2030	6 600	5 827	0,05
4,450 % éch. 20/02/2029	800	788	0,01
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 4,000 % éch. 30/06/2050	7 800	5 583	0,05
4,875 % éch. 17/07/2049	700	572	0,01
6,150 % éch. 21/05/2048	2 300	2 226	0,02
Total Indonésie		17 895	0,17
IRLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AerCap Ireland Capital DAC 1,150 % éch. 29/10/2023	1 310	1 289	0,01
1,650 % éch. 29/10/2024	2 900	2 727	0,03
2,450 % éch. 29/10/2026	3 200	2 861	0,03
2,875 % éch. 14/08/2024	3 300	3 173	0,03
3,150 % éch. 15/02/2024	6 200	6 084	0,06
4,450 % éch. 01/10/2025	400	385	0,00
4,450 % éch. 03/04/2026	5 475	5 233	0,05
5,772 % éch. 29/09/2023	4 900	4 893	0,05
AIB Group PLC 4,263 % éch. 10/04/2025	11 300	11 044	0,10
Bank of Ireland Group PLC 6,000 % éch. 01/09/2025 (g)(i)	€ 5 109	\$ 5 288	0,05
6,253 % éch. 16/09/2026	\$ 8 700	8 646	0,08
Perrigo Finance Unlimited Co. 4,900 % éch. 15/12/2044	4 800	3 719	0,04
SMBC Aviation Capital Finance DAC 3,550 % éch. 15/04/2024	3 800	3 721	0,04
4,125 % éch. 15/07/2023	6 600	6 595	0,06
STERIS Irish FinCo UnLtd Co. 2,700 % éch. 15/03/2031	2 900	2 419	0,02
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 5,125 % éch. 23/11/2052	£ 3 700	4 075	0,04
Total Irlande		72 152	0,69
ITALIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Aeroporti di Roma SpA 1,750 % éch. 30/07/2031	€ 1 700	1 507	0,01
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % éch. 17/07/2023	13 930	15 187	0,15
4,625 % éch. 06/02/2027	4 800	5 206	0,05
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,875 % éch. 09/01/2026	27 200	26 428	0,25
2,625 % éch. 28/04/2025	16 100	16 490	0,16
Intesa Sanpaolo SpA 4,000 % éch. 23/09/2029	\$ 10 600	9 218	0,09
5,017 % éch. 26/06/2024	5 900	5 717	0,05
5,710 % éch. 15/01/2026	14 819	14 117	0,14
Mundys SpA 1,625 % éch. 03/02/2025	€ 4 100	4 276	0,04
1,875 % éch. 13/07/2027	15 770	15 260	0,15

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF (en milliers)	JUSTE EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF (en milliers)	JUSTE EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF (en milliers)	JUSTE EN % DE L'ACTIF NET
1,875 % éch. 12/02/2028	€ 1 600	\$ 1 493	0,01	Aroundtown S.A.	£ 3 000	\$ 1 046	0,01	Cooperative Rabobank UA			
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA	2 800	2 906	0,03	3,000 % éch. 16/10/2029	€ 1 300	\$ 16 400	0,12	4,375 % éch.			
UniCredit SpA				5,375 % éch. 21/03/2029	\$ 16 400	12 152	0,12	29/06/2027 (g)(i)	€ 19 200	\$ 18 339	0,17
7,830 % éch. 04/12/2023	\$ 62 000	62 373	0,59	Becton Dickinson Euro Finance SARL	€ 4 500	4 128	0,04	4,655 % éch. 22/08/2028	\$ 6 800	6 514	0,06
		180 178	1,72	1,336 % éch. 13/08/2028	€ 5 180	3 617	0,03	CTP NV			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				CPI Property Group S.A.				0,500 % éch. 21/06/2025	€ 9 400	9 144	0,09
Obligation internationale du gouvernement italien	10 700	10 723	0,10	1,500 % éch. 27/01/2031	10 500	6 246	0,06	1,250 % éch. 21/06/2029	€ 12 800	10 145	0,10
6,875 % éch. 27/09/2023				1,750 % éch. 14/01/2030	10 900	7 218	0,07	Digital Dutch Finco BV			
Total Italie		190 901	1,82	Cromwell Ereit Lux Finco SARL				1,000 % éch. 15/01/2032	2 600	2 006	0,02
JAPON				2,125 % éch. 19/11/2025	19 575	18 432	0,17	1,250 % éch. 01/02/2031	12 400	10 114	0,10
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Helvetia Europe S.A.				EnBW International Finance BV			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	14 400	13 610	0,13	2,750 % éch. 30/09/2041	4 700	4 084	0,04	3,500 % éch. 24/07/2028	5 000	5 360	0,05
0,953 % éch. 19/07/2025	9 500	8 390	0,08	Logicor Financing SARL	23 950	21 721	0,21	4,000 % éch. 24/01/2035	7 300	7 795	0,07
1,538 % éch. 20/07/2027	15 400	12 499	0,12	1,625 % éch. 15/07/2027	23 950	21 721	0,21	Enel Finance International NV	\$ 6 000	504	0,00
2,048 % éch. 17/07/2030	5 600	4 952	0,05	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.	\$ 61 150	3 669	0,03	5,500 % éch. 15/06/2052	5 000	4 520	0,04
3,195 % éch. 18/07/2029	€ 3 100	3 332	0,03	5,125 % éch. 29/10/2022 ^	\$ 12 200	732	0,01	IMCD NV			
3,273 % éch. 19/09/2025	\$ 2 700	2 687	0,03	5,250 % éch. 23/05/2023 ^ (i)	12 200	732	0,01	2,500 % éch. 26/03/2025	€ 4 700	4 965	0,05
5,422 % éch. 22/02/2029	4 400	4 380	0,04	TMS Issuer SARL				ING Groep NV			
5,475 % éch. 22/02/2031				5,780 % éch. 23/08/2032	7 000	7 222	0,07	4,875 % éch.	\$ 21 300	16 554	0,16
Mizuho Financial Group, Inc.	7 100	5 615	0,05	CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS				16/05/2029 (g)(i)			
1,979 % éch. 08/09/2031	9 100	7 293	0,07	Delos Finance SARL	18 243	18 254	0,17	16/11/2026 (g)(i)	€ 10 000	8 840	0,08
2,201 % éch. 10/07/2031	€ 5 000	5 464	0,05	7,285 % éch. 06/10/2023				6,250 % éch. 20/05/2033	€ 5 200	6 133	0,06
4,416 % éch. 20/05/2033	\$ 800	799	0,01	Total Luxembourg		109 614	1,04	JAB Holdings BV			
5,739 % éch. 27/05/2031				ÎLE MAURICE				1,000 % éch. 20/12/2027	€ 5 000	4 759	0,05
Nissan Motor Co. Ltd.	€ 16 640	18 076	0,17	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				2,200 % éch. 23/11/2030	\$ 20 150	15 863	0,15
1,940 % éch. 15/09/2023	4 700	4 607	0,04	Greenko Solar Mauritius Ltd.	300	282	0,00	2,250 % éch. 19/12/2039	€ 4 800	3 716	0,04
3,201 % éch. 17/09/2028	\$ 14 220	12 943	0,12	5,950 % éch. 29/07/2026				5,000 % éch. 12/06/2033	3 600	3 991	0,04
4,345 % éch. 17/09/2027	6 550	5 750	0,06	India Green Energy Holdings	9 900	9 681	0,09	LeasePlan Corp. NV			
4,810 % éch. 17/09/2030				5,375 % éch. 29/04/2024		9 963	0,09	0,125 % éch. 13/09/2023	6 340	6 865	0,07
Nomura Holdings, Inc.	15 950	14 595	0,14	Total Île Maurice		9 963	0,09	2,875 % éch. 24/10/2024	\$ 1 020	972	0,01
1,851 % éch. 16/07/2025	5 000	4 223	0,04	ACTIONS				3,75 % éch.	€ 1 000	1 073	0,01
2,172 % éch. 14/07/2028	1 800	1 474	0,01	MEXIQUE				29/05/2024 (g)(i)			
2,679 % éch. 16/07/2030	9 800	8 270	0,08	ACTIONS ORDINAIRES				NE Property BV			
2,710 % éch. 22/01/2029	4 500	3 840	0,04	Desarrolladora Homex	427 064	0	0,00	1,875 % éch. 09/10/2026	3 500	3 316	0,03
3,103 % éch. 16/01/2030	9 500	9 527	0,09	S.A.B. de C.V. (d)				2,000 % éch. 20/01/2030	7 000	5 651	0,05
5,842 % éch. 18/01/2028	8 000	8 262	0,08	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,375 % éch. 19/01/2027	9 300	9 118	0,09
6,181 % éch. 18/01/2033				Banco Mercantil del Norte S.A.				NN Group NV			
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	11 500	11 116	0,11	6,625 % éch. 24/01/2032	\$ 9 600	7 430	0,07	4,625 % éch. 13/01/2048	2 000	2 109	0,02
2,440 % éch. 18/06/2024				(g)(i)				Prosus NV			
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	3 500	2 852	0,03	Petroleos Mexicanos	€ 200	174	0,00	1,539 % éch. 03/08/2028	3 700	3 328	0,03
2,696 % éch. 16/07/2024	4 700	4 549	0,04	2,750 % éch. 21/04/2027	€ 200	108	0,00	2,031 % éch. 03/08/2032	25 780	20 035	0,19
2,750 % éch. 15/01/2030	2 600	2 245	0,02	3,750 % éch. 21/02/2024	100	108	0,00	4,027 % éch. 03/08/2050	\$ 3 800	2 390	0,02
5,464 % éch. 13/01/2026	6 000	5 983	0,06	4,875 % éch. 21/02/2028	500	453	0,00	4,193 % éch. 19/01/2032	3 800	3 202	0,03
5,520 % éch. 13/01/2028	5 000	5 024	0,05	10,000 % éch. 07/02/2033	\$ 8 100	7 427	0,07	Sagax Euro MTN NL BV			
5,710 % éch. 13/01/2030	10 000	10 130	0,10	Trust Fibra Uno	1 900	1 680	0,02	0,750 % éch. 26/01/2028	€ 6 100	5 049	0,05
5,766 % éch. 13/01/2033	4 500	4 633	0,04	4,869 % éch. 15/01/2030		1 680	0,02	1,625 % éch. 24/02/2026	5 900	5 766	0,05
6,439 % éch. 13/01/2026	1 400	1 412	0,01	MULTINATIONALES				Siemens Energy Finance BV			
Suntory Holdings Ltd.	900	855	0,01	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,250 % éch. 05/04/2029	1 800	1 913	0,02
2,250 % éch. 16/10/2024				Delta Air Lines, Inc.	3 600	3 497	0,03	Syngenta Finance NV			
Total Japon		209 387	2,00	4,750 % éch. 20/10/2028				3,375 % éch. 16/04/2026	7 100	7 438	0,07
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				PAYS-BAS				4,892 % éch. 24/04/2025	\$ 6 784	6 645	0,06
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Volkswagen Financial Services NV			
AA Bond Co. Ltd.	£ 7 782	8 631	0,08	ABN AMRO Bank NV	€ 9 700	9 557	0,09	0,875 % éch. 20/02/2025	€ 7 000	8 105	0,08
5,500 % éch. 31/07/2050				4,375 % éch. 22/09/2025				1,125 % éch. 18/09/2023	13 700	17 244	0,16
G City Europe Ltd.	€ 24 900	23 768	0,23	(g)(i)				1,875 % éch. 03/12/2024	1 800	2 140	0,02
4,250 % éch. 11/09/2025				Arcadis NV	7 000	7 638	0,07	Vonovia Finance BV			
Gatwick Funding Ltd.	€ 300	304	0,00	4,875 % éch. 28/02/2028	7 000	7 638	0,07	0,500 % éch. 14/09/2029	€ 500	409	0,00
2,500 % éch. 15/04/2032	1 200	874	0,01	ASR Nederland NV	4 300	4 082	0,04	1,125 % éch. 14/09/2034	1 000	712	0,01
2,625 % éch. 07/10/2048	1 600	1 377	0,01	3,375 % éch. 02/05/2049	2 700	3 071	0,03	WPC Eurobond BV			
3,125 % éch. 28/09/2041				7,000 % éch. 07/12/2043				1,350 % éch. 15/04/2028	5 400	5 010	0,05
Heathrow Funding Ltd.	€ 3 800	3 483	0,04	BAT Netherlands Finance BV				TITRES ADOSSES À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
1,875 % éch. 12/07/2032	€ 1 300	1 351	0,01	5,375 % éch. 16/02/2031	5 300	5 780	0,06	EMF-NL Prime BV			
2,750 % éch. 13/10/2031				BP Capital Markets BV	2 500	2 726	0,03	3,977 % éch. 17/04/2041	395	411	0,01
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP	8 867	11 329	0,11	LUXEMBOURG				Eurosaïl BV			
5,844 % éch. 05/11/2031 (g)				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,677 % éch. 17/10/2040	129	141	0,00
Total Jersey, Îles Anglo-normandes		51 117	0,49	Alice Financing S.A.	€ 1 300	1 093	0,01	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
LUXEMBOURG				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				BNG Bank NV			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				NORVÈGE				2,375 % éch. 16/03/2026	\$ 9 300	8 741	0,08
Altice Financing S.A.	€ 1 300	1 093	0,01	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Total Pays-Bas		299 899	2,86
4,250 % éch. 15/08/2029				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Var Energi ASA			
LUXEMBOURG				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				8,000 % éch. 15/11/2032	5 000	5 303	0,05
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS							

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN VALEUR (en milliers)	% DE L'ACTIF NET
Yara International ASA 4,750 % éch. 01/06/2028	\$ 15 300	\$ 14 548	0,14
Total Norvège		19 851	0,19

PÉROU OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % éch. 17/09/2024	PEN 9 800	2 592	0,03
---	-----------	-------	------

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,350 % éch. 12/08/2028	23 400	6 550	0,06
7,300 % éch. 12/08/2033	213	61	0,00

Total Pérou		9 203	0,09
-------------	--	-------	------

POLOGNE ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement polonais 3,875 % éch. 14/02/2033	€ 7 400	8 020	0,08
4,250 % éch. 14/02/2043	2 300	2 469	0,02

Total Pologne		10 489	0,10
---------------	--	--------	------

QATAR ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement qatari 4,400 % éch. 16/04/2050	\$ 11 300	10 303	0,10
---	-----------	--------	------

ROUMANIE ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement roumain 1,375 % éch. 02/12/2029	€ 3 425	2 905	0,03
1,750 % éch. 13/07/2030	7 650	6 381	0,06
2,125 % éch. 07/03/2028	7 200	6 834	0,07
2,625 % éch. 02/12/2040	22 600	15 055	0,14
2,875 % éch. 13/04/2042	8 200	5 513	0,05

Total Roumanie		36 688	0,35
----------------	--	--------	------

RUSSIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

MMK International Capital DAC 4,375 % éch. 13/06/2024 *	\$ 4 900	294	0,00
--	----------	-----	------

ARABIE SAOUDITE ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 2,250 % éch. 02/02/2033	20 200	16 298	0,16
4,750 % éch. 18/01/2028	52 000	51 620	0,49
4,875 % éch. 18/07/2033	25 000	25 005	0,24
5,000 % éch. 18/01/2053	6 000	5 567	0,05

Total Arabie saoudite		98 490	0,94
-----------------------	--	--------	------

SINGAPOUR OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 1,832 % éch. 10/09/2030 (i)	13 500	12 315	0,12
---	--------	--------	------

Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 4,750 % éch. 19/05/2033	5 000	4 983	0,05
5,110 % éch. 19/05/2043	18 100	18 153	0,17

SP PowerAssets Ltd. 3,000 % éch. 26/09/2027	2 400	2 237	0,02
--	-------	-------	------

United Overseas Bank Ltd. 1,750 % éch. 16/03/2031 (i)	3 500	3 116	0,03
--	-------	-------	------

Total Singapour		40 804	0,39
-----------------	--	--------	------

SLOVAQUIE ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement slovaque 1,875 % éch. 09/03/2037	€ 500	436	0,00
---	-------	-----	------

SLOVÉNIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % éch. 27/01/2025	10 700	11 292	0,11
---	--------	--------	------

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN VALEUR (en milliers)	% DE L'ACTIF NET
AFRIQUE DU SUD OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AngloGold Ashanti Holdings PLC 3,375 % éch. 01/11/2028	\$ 5 500	\$ 4 823	0,05
3,750 % éch. 01/10/2030	7 800	6 701	0,06

		11 524	0,11
--	--	--------	------

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 1 231 200	67 685	0,64
--	---------------	--------	------

Total Afrique du Sud		79 209	0,75
----------------------	--	--------	------

CORÉE DU SUD OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Shinhan Bank Co. Ltd. 1,183 % éch. 29/09/2025	AUD 7 200	4 359	0,04
--	-----------	-------	------

Shinhan Financial Group Co. Ltd. 3,340 % éch. 05/02/2030 (i)	\$ 3 000	2 873	0,03
---	----------	-------	------

Total Corée du Sud		7 232	0,07
--------------------	--	-------	------

ESPAGNE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % éch. 24/09/2023 (g)(i)	€ 3 200	3 463	0,03
---	---------	-------	------

CaixaBank S.A. 3,625 % éch. 14/09/2028 (g)(i)	5 400	4 020	0,04
---	-------	-------	------

Werfen S.A. 4,625 % éch. 06/06/2028	11 100	11 959	0,12
--	--------	--------	------

Total Espagne		19 442	0,19
---------------	--	--------	------

SUPRANATIONALES OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Banque européenne pour la reconstruction et le développement 1,500 % éch. 13/02/2025	\$ 5 200	4 910	0,05
---	----------	-------	------

1,625 % éch. 27/09/2024	500	478	0,01
-------------------------	-----	-----	------

Banque européenne d'investissement 0,750 % éch. 15/11/2024	£ 15 350	18 242	0,17
---	----------	--------	------

Total Supranationales		23 630	0,23
-----------------------	--	--------	------

SUÈDE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Castellum AB 2,125 % éch. 20/11/2023	€ 4 300	4 621	0,04
---	---------	-------	------

Fastighets AB Balder 1,125 % éch. 29/01/2027	4 500	3 702	0,04
---	-------	-------	------

Sagax AB 1,125 % éch. 30/01/2027	4 200	3 867	0,04
-------------------------------------	-------	-------	------

2,250 % éch. 13/03/2025	8 400	8 659	0,08
-------------------------	-------	-------	------

Total Suède		20 849	0,20
-------------	--	--------	------

SUISSE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Credit Suisse AG 6,500 % éch. 08/08/2023 (i)	\$ 95 950	95 601	0,91
---	-----------	--------	------

UBS Group AG 1,494 % éch. 10/08/2027	5 000	4 298	0,04
---	-------	-------	------

2,593 % éch. 11/09/2025	18 030	17 193	0,17
-------------------------	--------	--------	------

3,126 % éch. 13/08/2030	400	337	0,00
-------------------------	-----	-----	------

4,125 % éch. 24/09/2025	58 990	56 395	0,54
-------------------------	--------	--------	------

4,177 % éch. 16/01/2026	€ 3 550	3 814	0,04
-------------------------	---------	-------	------

4,750 % éch. 17/03/2032	12 900	14 034	0,13
-------------------------	--------	--------	------

Total Suisse		191 672	1,83
--------------	--	---------	------

THAÏLANDE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Bangkok Bank PCL 3,466 % éch. 23/09/2036 (i)	\$ 9 200	7 507	0,07
---	----------	-------	------

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN VALEUR (en milliers)	% DE L'ACTIF NET
TURQUIE OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Turkish Airlines Pass-Through Trust 4,200 % éch. 15/09/2028	\$ 4 094	\$ 3 772	0,04

ÉMIRATS ARABES UNIS OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

DAE Sukuk Dfc Ltd. 3,750 % éch. 15/02/2026	8 600	8 184	0,08
---	-------	-------	------

ROYAUME-UNI OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

Barclays PLC 2,645 % éch. 24/06/2031	8 000	6 422	0,06
---	-------	-------	------

4,375 % éch. 12/01/2026	9 860	9 477	0,09
-------------------------	-------	-------	------

5,501 % éch. 09/08/2028	7 550	7 369	0,07
-------------------------	-------	-------	------

6,224 % éch. 09/05/2034	5 900	5 880	0,06
-------------------------	-------	-------	------

7,750 % éch. 15/09/2023 (g)(i)	700	688	0,01
--------------------------------	-----	-----	------

8,000 % éch. 15/06/2024 (g)(i)	4 300	4 074	0,04
--------------------------------	-------	-------	------

BAT International Finance PLC 1,668 % éch. 25/03/2026	5 990	5 388	0,05
--	-------	-------	------

2,250 % éch. 26/06/2028	£ 8 100	8 232	0,08
-------------------------	---------	-------	------

BP Capital Markets PLC 5,773 % éch. 25/05/2038	1 200	1 505	0,01
---	-------	-------	------

Broadgate Financing PLC 4,851 % éch. 05/04/2033	49	59	0,00
--	----	----	------

Cadent Finance PLC 2,625 % éch. 22/09/2038	300	246	0,00
---	-----	-----	------

2,750 % éch. 22/09/2046	3 200	2 368	0,02
-------------------------	-------	-------	------

Chanel Ceres PLC 0,500 % éch. 31/07/2026	€ 11 800	11 477	0,11
---	----------	--------	------

1,000 % éch. 31/07/2031	6 800	5 925	0,06
-------------------------	-------	-------	------

Connect Plus M25 Issuer PLC 2,607 % éch. 31/03/2039	£ 2 022	2 000	0,02
--	---------	-------	------

Direct Line Insurance Group PLC 4,000 % éch. 05/06/2032	1 200	1 104	0,01
--	-------	-------	------

DWR Cymru Financing UK PLC 3,514 % éch. 31/03/2030	31	44	0,00
---	----	----	------

Ferguson Finance PLC 3,250 % éch. 02/06/2030	\$ 4 300	3 737	0,04
---	----------	-------	------

Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,250 % éch. 25/02/2030	7 700	4 889	0,05
---	-------	-------	------

Greene King Finance PLC 0,000 % éch. 15/03/2036	£ 900	864	0,01
--	-------	-----	------

4,064 % éch. 15/03/2035	4 469	4 659	0,04
-------------------------	-------	-------	------

5,106 % éch. 15/03/2034	89	100	0,00
-------------------------	----	-----	------

5,318 % éch. 15/09/2031	221	253	0,00
-------------------------	-----	-----	------

HSBC Holdings PLC 1,750 % éch. 24/07/2027	19 060	20 661	0,20
--	--------	--------	------

2,357 % éch. 18/08/2031	\$ 6 600	5 272	0,05
-------------------------	----------	-------	------

2,848 % éch. 04/06/2031	8 500	7 058	0,07
-------------------------	-------	-------	------

3,973 % éch. 22/05/2030	11 300	10 158	0,10
-------------------------	--------	--------	------

4,041 % éch. 13/03/2028	17 400	16 309	0,16
-------------------------	--------	--------	------

4,292 % éch. 12/09/2026	2 500	2 405	0,02
-------------------------	-------	-------	------

4,600 % éch. 17/12/2030 (g)(i)	11 900	9 089	0,09
--------------------------------	--------	-------	------

6,920 % éch. 12/09/2026	526	530	0,01
-------------------------	-----	-----	------

Imperial Brands Finance PLC 3,125 % éch. 26/07/2024	1 300	1 256	0,01
--	-------	-------	------

3,500 % éch. 26/07/2026	21 660	20 187	0,19
-------------------------	--------	--------	------

3,875 % éch. 26/07/2029	11 840	10 446	0,10
-------------------------	--------	--------	------

Informa PLC 1,250 % éch. 22/04/2028	€ 9 200	8 720	0,08
--	---------	-------	------

1,500 % éch. 05/07/2023	7 818	8 529	0,08
-------------------------	-------	-------	------

2,125 % éch. 06/10/2025	17 190	17 895	0,17
-------------------------	--------	--------	------

3,125 % éch. 05/07/2026	£ 100	114	0,00
-------------------------	-------	-----	------

InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % éch. 08/10/2024	€ 15 000	15 819	0,15
--	----------	--------	------

3,375 % éch. 08/10/2028	£ 7 800	8
-------------------------	---------	---

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET
2,651 % éch. 11/03/2032	\$ 10 000	\$ 8 286 0,08	Charter Communications Operating LLC			Doctors Co. An Interinsurance Exchange		
2,687 % éch. 22/04/2032	3 400	2 819 0,03	2,250 % éch. 15/01/2029	\$ 7 920	\$ 6 599 0,06	4,500 % éch. 18/01/2032	\$ 900	\$ 715 0,01
4,271 % éch. 23/07/2029	2 300	2 184 0,02	2,300 % éch. 01/02/2032	11 000	8 333 0,08	DTE Electric Co.		
4,300 % éch. 28/01/2025 (g)	27 900	24 970 0,24	3,500 % éch. 01/06/2041	9 200	6 231 0,06	1,900 % éch. 01/04/2028	4 700	4 116 0,04
5,015 % éch. 22/07/2033	5 000	4 894 0,05	3,700 % éch. 01/04/2051	6 800	4 302 0,04	5,200 % éch. 01/04/2033	3 500	3 558 0,03
6,233 % éch. 23/07/2024	35 600	35 611 0,34	3,900 % éch. 01/06/2052	1 700	1 114 0,01	Duke Energy Carolinas LLC		
Bank of America N.A.			4,400 % éch. 01/12/2061	750	507 0,00	4,000 % éch. 30/09/2042	122	101 0,00
6,000 % éch. 15/10/2036	7 150	7 647 0,07	4,800 % éch. 01/03/2050	8 400	6 345 0,06	Duke Energy Corp.		
BAT Capital Corp.			5,125 % éch. 01/07/2049	12 300	9 687 0,09	3,850 % éch. 15/06/2034	€ 16 000	15 964 0,15
2,726 % éch. 25/03/2031	6 500	5 180 0,05	5,375 % éch. 01/04/2038	6 300	5 372 0,05	4,300 % éch. 15/03/2028	\$ 3 613	3 473 0,03
Bayer U.S. Finance LLC			Cheniere Corpus Christi Holdings LLC			Duke Energy Indiana LLC		
4,250 % éch. 15/12/2025	400	386 0,00	3,700 % éch. 15/11/2029	9 000	8 157 0,08	5,400 % éch. 01/04/2053	1 218	1 230 0,01
4,375 % éch. 15/12/2028	22 680	21 526 0,21	5,125 % éch. 30/06/2027	13 132	12 918 0,12	Duke Energy Ohio, Inc.		
6,562 % éch. 15/12/2023	6 900	6 893 0,07	Cheniere Energy Partners LP			5,650 % éch. 01/04/2053	1 868	1 918 0,02
Becton Dickinson & Co.			3,250 % éch. 31/01/2032	6 600	5 439 0,05	Duke Energy Progress LLC		
0,034 % éch. 13/08/2025	€ 2 300	2 310 0,02	4,000 % éch. 01/03/2031	11 900	10 491 0,10	5,250 % éch. 15/03/2033	5 283	5 371 0,05
Berry Global, Inc.			5,950 % éch. 30/06/2033	9 900	9 941 0,09	Edison International		
1,000 % éch. 15/01/2025	9 900	10 286 0,10	Choice Hotels International, Inc.			8,125 % éch. 15/06/2053	1 230	1 258 0,01
1,500 % éch. 15/01/2027	9 100	8 934 0,09	3,700 % éch. 01/12/2029	700	604 0,01	Enel Finance America LLC		
4,875 % éch. 15/07/2026	\$ 3 100	2 983 0,03	Citigroup, Inc.			7,100 % éch. 14/10/2027	2 800	2 944 0,03
BGC Partners, Inc.			2,572 % éch. 03/06/2031 (j)	24 700	20 619 0,20	Energy Transfer LP		
8,000 % éch. 25/05/2028	5 600	5 416 0,05	Cleveland Electric Illuminating Co.			4,400 % éch. 15/03/2027	6 745	6 453 0,06
Black Hills Corp.			3,500 % éch. 01/04/2028	2 965	2 720 0,03	5,150 % éch. 01/02/2043	2 294	1 952 0,02
1,037 % éch. 23/08/2024	1 200	1 134 0,01	Comcast Corp.			5,150 % éch. 15/03/2045	7 503	6 481 0,06
4,250 % éch. 30/11/2023	2 500	2 483 0,02	5,350 % éch. 15/05/2053	13 100	13 313 0,13	5,300 % éch. 01/04/2044	4 130	3 586 0,03
5,950 % éch. 15/03/2028	2 990	3 027 0,03	Constellation Energy Generation LLC			5,300 % éch. 15/04/2047	675	588 0,01
Blackstone Private Credit Fund			5,600 % éch. 01/03/2028	1 600	1 613 0,02	5,350 % éch. 15/05/2045	7 181	6 286 0,06
2,350 % éch. 22/11/2024	13 100	12 246 0,12	5,750 % éch. 01/10/2041	2 500	2 450 0,02	7,500 % éch. 01/07/2038	5 734	6 295 0,06
Boeing Co.			Continental Resources, Inc.			7,600 % éch. 01/02/2024	10 400	10 462 0,10
2,196 % éch. 04/02/2026	23 500	21 578 0,21	2,875 % éch. 01/04/2032	15 595	11 992 0,11	Entergy Louisiana LLC		
3,250 % éch. 01/02/2028	4 400	4 043 0,04	5,750 % éch. 15/01/2031	300	285 0,00	3,780 % éch. 01/04/2025	25 100	24 340 0,23
5,150 % éch. 01/05/2030	1 706	1 691 0,02	Corporate Office Properties LP			Entergy Mississippi LLC		
5,930 % éch. 01/05/2060	5 000	4 956 0,05	2,250 % éch. 15/03/2026	5 200	4 610 0,04	5,000 % éch. 01/09/2033	1 000	982 0,01
Booking Holdings, Inc.			CoStar Group, Inc.			Enterprise Products Operating LLC		
4,125 % éch. 12/05/2033	€ 1 900	2 064 0,02	2,800 % éch. 15/07/2030	5 200	4 295 0,04	5,250 % éch. 16/08/2077	4 739	4 156 0,04
Boston Scientific Corp.			Cox Communications, Inc.			5,375 % éch. 15/02/2078	5 614	4 658 0,04
2,650 % éch. 01/06/2030	\$ 5 900	5 144 0,05	5,450 % éch. 15/09/2028	3 500	3 498 0,03	8,304 % éch. 16/08/2077	5 988	5 903 0,06
BP Capital Markets America, Inc.			Credit Suisse AG AT1 Claim ^			EPR Properties		
4,812 % éch. 13/02/2033	2 000	1 972 0,02	Crown Castle Towers LLC			4,500 % éch. 01/04/2025	4 420	4 189 0,04
British Airways Pass-Through Trust			4,241 % éch. 15/07/2048	5 800	5 391 0,05	4,500 % éch. 01/06/2027	6 440	5 785 0,06
3,300 % éch. 15/06/2034	11 816	10 273 0,10	Crown Castle, Inc.			4,750 % éch. 15/12/2026	4 425	4 031 0,04
3,350 % éch. 15/12/2030	789	690 0,01	2,250 % éch. 15/01/2031	12 500	10 199 0,10	4,950 % éch. 15/04/2028	1 986	1 776 0,02
3,800 % éch. 20/03/2033	68	62 0,00	3,100 % éch. 15/11/2029	12 805	11 167 0,11	Equifax, Inc.		
4,125 % éch. 20/03/2033	68	61 0,00	3,250 % éch. 15/01/2051	5 400	3 687 0,04	5,100 % éch. 01/06/2028	7 900	7 790 0,07
4,250 % éch. 15/05/2034	674	616 0,01	3,800 % éch. 15/02/2028	3 765	3 513 0,03	Evergy Missouri West, Inc.		
4,625 % éch. 20/12/2025	574	567 0,01	4,300 % éch. 15/02/2029	4 000	3 766 0,04	5,150 % éch. 15/12/2027	2 000	1 975 0,02
Broadcom, Inc.			CVS Health Corp.			Eversource Energy		
2,450 % éch. 15/02/2031	12 900	10 497 0,10	5,000 % éch. 30/01/2029	7 000	6 936 0,07	5,125 % éch. 15/05/2033	300	296 0,00
2,600 % éch. 15/02/2033	3 300	2 581 0,02	5,250 % éch. 30/01/2031	12 400	12 365 0,12	Exelon Corp.		
3,187 % éch. 15/11/2036	34 991	26 464 0,25	CVS Pass-Through Trust			4,050 % éch. 15/04/2030	3 540	3 312 0,03
3,469 % éch. 15/04/2034	18 649	15 305 0,15	4,704 % éch. 10/01/2036	208	192 0,00	Expedia Group, Inc.		
3,500 % éch. 15/02/2041	200	150 0,00	5,926 % éch. 10/01/2034	1 926	1 829 0,02	3,250 % éch. 15/02/2030	7 000	6 098 0,06
4,926 % éch. 15/05/2037	17 568	15 909 0,15	6,036 % éch. 10/12/2028	1 096	1 087 0,01	3,800 % éch. 15/02/2028	10 805	10 115 0,10
Brookfield Capital Finance LLC			7,507 % éch. 10/01/2032	1 255	1 309 0,01	6,250 % éch. 01/05/2025	983	987 0,01
6,087 % éch. 14/06/2033	7 700	7 823 0,07	8,353 % éch. 10/07/2031	230	247 0,00	Fells Point Funding Trust		
Brooklyn Union Gas Co.			DAE Funding LLC			3,046 % éch. 31/01/2027	6 150	5 658 0,05
3,865 % éch. 04/03/2029	500	455 0,00	1,550 % éch. 01/08/2024	6 333	6 014 0,06	FirstEnergy Transmission LLC		
Burlington Northern Santa Fe LLC			1,625 % éch. 15/02/2024	3 100	2 989 0,03	4,550 % éch. 01/04/2049	2 083	1 740 0,02
4,450 % éch. 15/01/2053	344	315 0,00	3,375 % éch. 20/03/2028	24 600	22 197 0,21	Fiserv, Inc.		
5,200 % éch. 15/04/2054	11 056	11 288 0,11	Daimler Truck Finance North America LLC			3,000 % éch. 01/07/2031	€ 800	815 0,01
Caesars Entertainment, Inc.			1,625 % éch. 13/12/2024	2 900	2 731 0,03	Flex Intermediate Holdco LLC		
7,000 % éch. 15/02/2030	8 500	8 544 0,08	2,000 % éch. 14/12/2026	7 510	6 709 0,06	3,363 % éch. 30/06/2031	\$ 34 000	27 077 0,26
Cameron LNG LLC			Dell International LLC			Ford Foundation		
3,402 % éch. 15/01/2038	4 300	3 587 0,03	4,900 % éch. 01/10/2026	11 010	10 937 0,10	2,815 % éch. 01/06/2070	1 600	991 0,01
3,701 % éch. 15/01/2039	8 325	6 881 0,07	5,300 % éch. 01/10/2029	4 500	4 470 0,04	Ford Motor Credit Co. LLC		
Cantor Fitzgerald LP			6,020 % éch. 15/06/2026	23 099	23 489 0,22	2,330 % éch. 25/11/2025	€ 5 450	5 589 0,05
4,500 % éch. 14/04/2027	100	94 0,00	Delta Air Lines, Inc.			3,021 % éch. 06/03/2024	13 290	14 326 0,14
4,875 % éch. 01/05/2024	3 500	3 425 0,03	2,900 % éch. 28/10/2024	14 442	13 877 0,13	3,250 % éch. 15/09/2025	1 400	1 469 0,01
Capital One Financial Corp.			3,750 % éch. 28/10/2029	18 900	17 014 0,16	4,053 % éch. 15/11/2023	1 033	1 126 0,01
6,312 % éch. 08/06/2029	9 800	9 742 0,09	Digital Realty Trust LP			4,174 % éch. 01/12/2024	3 187	3 435 0,03
Carlyle Holdings Finance LLC			5,550 % éch. 15/01/2028	5 000	4 931 0,05	4,535 % éch. 06/03/2025	€ 2 900	3 506 0,03
5,625 % éch. 30/03/2043	100	88 0,00	Discovery Communications LLC			Freedom Mortgage Corp.		
CDW LLC			2,500 % éch. 20/09/2024	£ 2 400	2 902 0,03	8,125 % éch. 15/11/2024	\$ 4 380	4 344 0,04
3,569 % éch. 01/12/2031	6 500	5 494 0,05	DISH DBS Corp.			8,250 % éch. 15/04/2025	4 871	4 755 0,05
Centene Corp.			5,250 % éch. 01/12/2026	\$ 3 100	2 493 0,02	FS KKR Capital Corp.		
2,450 % éch. 15/07/2028	20 800	17 799 0,17	5,750 % éch. 01/12/2028	3 100	2 312 0,02	1,650 % éch. 12/10/2024	12 300	11 443 0,11
3,000 % éch. 15/10/2030	21 000	17 519 0,17				2,625 % éch. 15/01/2027	5 400	4 608 0,04

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET			
Georgia Power Co. 3,250 % éch. 15/03/2051	\$ 200	\$ 141	0,00	JPMorgan Chase & Co. 2,069 % éch. 01/06/2029	\$ 6 600	\$ 5 665	0,05	Monongahela Power Co. 5,400 % éch. 15/12/2043	\$ 150	\$ 146	0,00
4,950 % éch. 17/05/2033	5 000	4 938	0,05	2,301 % éch. 15/10/2025	32 500	30 982	0,30	Morgan Stanley 0,000 % éch. 02/04/2032 (j)	46 900	29 310	0,28
Global Payments, Inc. 4,875 % éch. 17/03/2031	€ 8 600	9 351	0,09	2,545 % éch. 08/11/2032	10 000	8 197	0,08	5,250 % éch. 21/04/2034	2 700	2 667	0,03
5,950 % éch. 15/08/2052	\$ 2 200	2 108	0,02	2,580 % éch. 22/04/2032	16 700	13 877	0,13	MSCI, Inc. 3,250 % éch. 15/08/2033	700	564	0,01
GLP Capital LP 4,000 % éch. 15/01/2030	1 500	1 301	0,01	2,739 % éch. 15/10/2030	35 800	30 872	0,29	3,625 % éch. 01/09/2030	2 500	2 158	0,02
4,000 % éch. 15/01/2031	4 000	3 462	0,03	3,702 % éch. 06/05/2030	9 300	8 531	0,08	4,000 % éch. 15/11/2029	5 350	4 847	0,05
5,300 % éch. 15/01/2029	15 224	14 509	0,14	3,782 % éch. 01/02/2028	3 569	3 397	0,03	Nasdaq, Inc. 5,350 % éch. 28/06/2028	400	401	0,00
5,375 % éch. 15/04/2026	5 600	5 487	0,05	3,797 % éch. 23/07/2024	7 500	7 491	0,07	National Fuel Gas Co. 2,950 % éch. 01/03/2031	3 700	2 963	0,03
5,750 % éch. 01/06/2028	14 330	14 033	0,13	4,565 % éch. 14/06/2030	10 000	9 618	0,09	National Health Investors, Inc. 3,000 % éch. 01/02/2031	1 800	1 384	0,01
Goldman Sachs Group, Inc. 2,383 % éch. 21/07/2032	4 100	3 286	0,03	5,350 % éch. 01/06/2034	5 000	5 042	0,05	Nationwide Financial Services, Inc. 3,900 % éch. 30/11/2049	8 800	6 436	0,06
2,600 % éch. 07/02/2030	5 000	4 263	0,04	5,100 % éch. 22/03/2043	6 700	6 816	0,07	Nationwide Mutual Insurance Co. 9,375 % éch. 15/08/2039	200	258	0,00
4,223 % éch. 01/05/2029	19 400	18 336	0,17	Kilroy Realty LP 2,500 % éch. 15/11/2032	1 100	765	0,01	Netflix, Inc. 3,625 % éch. 15/06/2030	€ 29 473	30 654	0,29
4,482 % éch. 23/08/2028	17 300	16 737	0,16	Kinder Morgan, Inc. 7,420 % éch. 15/02/2037	3 500	3 795	0,04	3,875 % éch. 15/11/2029	17 950	19 123	0,18
6,491 % éch. 15/05/2026	14 800	14 983	0,14	8,050 % éch. 15/10/2030	36	40	0,00	Neuberger Berman Group LLC 4,500 % éch. 15/03/2027	\$ 12 200	11 514	0,11
7,250 % éch. 10/04/2028	£ 3 817	4 973	0,05	KKR Financial Holdings LLC 5,400 % éch. 23/05/2033	10 400	9 692	0,09	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % éch. 15/06/2028	5 000	4 290	0,04
Goodman U.S. Finance Four LLC 4,500 % éch. 15/10/2037	\$ 7 182	5 999	0,06	KKR Group Finance Co. LLC 5,400 % éch. 25/02/2050	1 300	896	0,01	4,800 % éch. 01/12/2077	140	123	0,00
Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % éch. 23/06/2025	12 875	11 685	0,11	Kraft Heinz Foods Co. 4,125 % éch. 01/07/2027	£ 6 150	7 237	0,07	5,250 % éch. 28/02/2053	5 000	4 820	0,05
Guardian Life Global Funding 1,100 % éch. 23/06/2025	3 000	2 731	0,03	4,375 % éch. 01/06/2046	\$ 25 000	21 264	0,20	5,481 % éch. 03/11/2023	3 930	3 930	0,04
Gulfstream Natural Gas System LLC 4,600 % éch. 15/09/2025	4 560	4 385	0,04	Las Vegas Sands Corp. 3,200 % éch. 08/08/2024	51 200	49 623	0,47	5,650 % éch. 01/05/2079	500	465	0,00
Haleon U.S. Capital LLC 3,625 % éch. 24/03/2032	500	448	0,00	3,500 % éch. 18/08/2026	3 900	3 635	0,03	NGPL PipeCo LLC 4,875 % éch. 15/08/2027	8 855	8 397	0,08
Hanover Insurance Group, Inc. 4,500 % éch. 15/04/2026	740	717	0,01	Lazard Group LLC 4,375 % éch. 11/03/2029	4 968	4 616	0,04	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 1,850 % éch. 16/09/2026	15 000	12 734	0,12
HCA, Inc. 3,500 % éch. 15/07/2051	3 800	2 633	0,03	Lehman Brothers Holdings, Inc. 0,000 % éch. 23/12/2010 ^	900	2	0,00	NVR, Inc. 3,000 % éch. 15/05/2030	21 840	18 936	0,18
4,125 % éch. 15/06/2029	3 100	2 870	0,03	5,259 % éch. 12/06/2013 ^	€ 2 807	16	0,00	Oaktree Specialty Lending Corp. 3,500 % éch. 25/02/2025	2 000	1 895	0,02
4,500 % éch. 15/02/2027	3 800	3 668	0,03	6,875 % éch. 02/05/2018 ^	\$ 3 000	7	0,00	Occidental Petroleum Corp. 6,200 % éch. 15/03/2040	3 750	3 701	0,04
5,500 % éch. 01/06/2033	22 550	22 524	0,21	Laidos, Inc. 2,300 % éch. 15/02/2031	2 034	1 604	0,02	6,600 % éch. 15/03/2046	2 000	2 062	0,02
Highwoods Realty LP 2,600 % éch. 01/02/2031	6 800	4 991	0,05	Level 3 Financing, Inc. 3,625 % éch. 15/01/2029	700	421	0,00	6,625 % éch. 01/09/2030	1 000	1 040	0,01
4,200 % éch. 15/04/2029	2 500	2 109	0,02	3,875 % éch. 15/11/2029	4 000	3 187	0,03	8,875 % éch. 15/07/2030	4 850	5 579	0,05
Host Hotels & Resorts LP 2,900 % éch. 15/12/2031	2 500	1 969	0,02	Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % éch. 23/05/2059	€ 2 900	3 013	0,03	Oklahoma Gas & Electric Co. 5,400 % éch. 15/01/2033	3 269	3 324	0,03
3,375 % éch. 15/12/2029	4 700	4 021	0,04	4,569 % éch. 01/02/2029	\$ 800	755	0,01	Omega Healthcare Investors, Inc. 5,250 % éch. 15/01/2026	4 200	4 047	0,04
3,500 % éch. 15/09/2030	2 600	2 206	0,02	Marriott International, Inc. 3,500 % éch. 15/10/2032	11 240	9 717	0,09	OneMain Finance Corp. 6,875 % éch. 15/03/2025	5 400	5 352	0,05
3,875 % éch. 01/04/2024	8 200	8 070	0,08	4,150 % éch. 01/12/2023	3 900	3 881	0,04	ONEOK, Inc. 4,350 % éch. 15/03/2029	21 030	19 568	0,19
4,000 % éch. 15/06/2025	1 625	1 563	0,01	Marvell Technology, Inc. 2,450 % éch. 15/04/2028	15 000	13 107	0,12	6,100 % éch. 15/11/2032	4 300	4 376	0,04
Howard Midstream Energy Partners LLC 8,875 % éch. 15/07/2028 (b)	1 000	1 006	0,01	MassMutual Global Funding 3,400 % éch. 08/03/2026	3 700	3 519	0,03	Oracle Corp. 3,600 % éch. 01/04/2050	500	358	0,00
Hudson Pacific Properties LP 3,250 % éch. 15/01/2030	2 325	1 474	0,01	Merck & Co., Inc. 5,150 % éch. 17/05/2063	2 100	2 147	0,02	3,850 % éch. 01/04/2060	1 800	1 270	0,01
3,950 % éch. 01/11/2027	3 000	2 184	0,02	Meta Platforms, Inc. 5,600 % éch. 15/05/2053	12 800	13 155	0,13	4,100 % éch. 25/03/2061 (j)	6 600	4 877	0,05
5,950 % éch. 15/02/2028	100	80	0,00	MetLife Capital Trust 7,875 % éch. 15/12/2067	3 282	3 444	0,03	4,900 % éch. 06/02/2033	1 800	1 748	0,02
Humana, Inc. 5,875 % éch. 01/03/2033	6 000	6 238	0,06	MetLife, Inc. 5,875 % éch. 15/03/2028 (g)	7 400	6 893	0,07	6,250 % éch. 09/11/2032 (j)	14 500	15 398	0,15
Hyundai Capital America 0,875 % éch. 14/06/2024	12 010	11 457	0,11	Metropolitan Edison Co. 4,000 % éch. 15/04/2025	6 300	6 037	0,06	Organon & Co. 2,875 % éch. 30/04/2028	€ 2 300	2 184	0,02
1,500 % éch. 15/06/2026	10 200	9 038	0,09	Mid-America Apartments LP 1,100 % éch. 15/09/2026	2 600	2 270	0,02	Ovintiv, Inc. 6,250 % éch. 15/07/2033	\$ 3 000	2 961	0,03
Infor, Inc. 1,450 % éch. 15/07/2023	7 100	7 088	0,07	1,600 % éch. 01/06/2027	1 925	1 820	0,02	Pacific Gas & Electric Co. 2,500 % éch. 01/02/2031	500	392	0,00
1,750 % éch. 15/07/2025	4 700	4 293	0,04	3,950 % éch. 15/03/2029	6 857	6 464	0,06	2,950 % éch. 01/03/2026 ^	6 700	6 141	0,06
Integrus Baptist Medical Center, Inc. 3,875 % éch. 15/08/2050	8 300	6 274	0,06	MID-Atlantic Interstate Transmission LLC 4,100 % éch. 15/05/2028	7 140	6 757	0,06	3,000 % éch. 15/06/2028	16 330	14 091	0,13
Intercontinental Exchange, Inc. 3,000 % éch. 15/09/2060	9 450	6 194	0,06	Midwest Connector Capital Co. LLC 3,900 % éch. 01/04/2024	30 282	29 655	0,28	3,150 % éch. 01/01/2026	7 209	6 693	0,06
International Flavors & Fragrances, Inc. 1,832 % éch. 15/10/2027	5 000	4 221	0,04	Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % éch. 20/06/2027	6 320	6 341	0,06	3,300 % éch. 15/03/2027 ^	11 935	10 842	0,10
Invitation Homes Operating Partnership LP 4,150 % éch. 15/04/2032	1 500	1 345	0,01	Mississippi Power Co. 3,950 % éch. 30/03/2028	100	94	0,00	3,300 % éch. 01/12/2027 ^	15 869	13 926	0,13
Ipalco Enterprises, Inc. 3,700 % éch. 01/09/2024	2 858	2 764	0,03	4,250 % éch. 15/03/2042	2 600	2 169	0,02	3,400 % éch. 15/08/2024 ^	9 676	9 366	0,09
4,250 % éch. 01/05/2030	200	181	0,00					3,450 % éch. 01/07/2025	5 877	5 552	0,05
Jackson National Life Global Funding 2,650 % éch. 21/06/2024	600	581	0,01					3,500 % éch. 15/06/2025 ^	13 400	12 692	0,12
Jersey Central Power & Light Co. 4,300 % éch. 15/01/2026	880	852	0,01					3,750 % éch. 15/08/2042 ^	3 300	2 287	0,02
4,700 % éch. 01/04/2024	3 800	3 761	0,04					3,850 % éch. 15/11/2023 ^	5 177	5 132	0,05
JetBlue Pass-Through Trust 4,000 % éch. 15/05/2034	920	840	0,01					4,000 % éch. 01/12/2046 ^	100	67	0,00
								4,200 % éch. 01/06/2041	2 173	1 622	0,02
								4,450 % éch. 15/04/2042 ^	8 543	6 479	0,06
								4,500 % éch. 15/12/2041 ^	3 400	2 509	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	
4,650 % éch. 01/08/2028	\$ 1 600	\$ 1 481	0,01	SCE Recovery Funding LLC	\$ 3 100	\$ 3 067	0,03	Time Warner Cable Enterprises LLC	\$ 400	\$ 440	0,00	
4,750 % éch. 15/02/2044 ^	1 889	1 468	0,01	5,112 % éch. 14/12/2049				8,375 % éch. 15/07/2033				
5,900 % éch. 15/06/2032	1 900	1 830	0,02	Sempra Energy	4 100	3 322	0,03	Times Square Hotel Trust	4 164	4 119	0,04	
6,700 % éch. 01/04/2053	7 000	6 879	0,07	4,125 % éch. 01/04/2052	11 200	11 134	0,11	Trans-Allegheny Interstate Line Co.	3 850	1 157	0,01	
Pacific Life Global Funding				5,500 % éch. 01/08/2033				Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC	6 000	5 339	0,05	
1,200 % éch. 24/06/2025	8 100	7 390	0,07	SLM Corp.	2 200	2 046	0,02	3,250 % éch. 15/05/2030				
PacifiCorp				4,200 % éch. 29/10/2025				Trimble, Inc.	1 300	1 318	0,01	
6,250 % éch. 15/10/2037	3 600	3 601	0,03	Southern California Edison Co.	1 110	929	0,01	6,100 % éch. 15/03/2033				
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC				2,250 % éch. 01/06/2030	1 110	929	0,01	Trust Financial Corp.	5 000	4 809	0,05	
4,375 % éch. 15/10/2028	1 700	1 474	0,01	2,500 % éch. 01/06/2031	4 631	3 855	0,04	4,873 % éch. 26/01/2029	1 700	1 612	0,02	
PECO Energy Co.				2,750 % éch. 01/02/2032	6 400	5 358	0,05	5,122 % éch. 26/01/2034				
3,000 % éch. 15/09/2049	200	140	0,00	2,950 % éch. 01/02/2051	6 400	4 200	0,04	U.S. Airways Pass-Through Trust	987	979	0,01	
Pennsylvania Electric Co.				3,450 % éch. 01/02/2052	5 800	4 159	0,04	U.S. Bancorp	3 500	3 347	0,03	
3,600 % éch. 01/06/2029	6 770	6 153	0,06	3,650 % éch. 01/06/2051	4 300	3 198	0,03	UDR, Inc.	7 100	6 013	0,06	
4,150 % éch. 15/04/2025	2 205	2 123	0,02	3,900 % éch. 01/12/2041	450	353	0,00	3,000 % éch. 15/08/2031				
6,150 % éch. 01/10/2038	4 415	4 402	0,04	4,000 % éch. 01/04/2047	11 644	9 262	0,09	United Airlines Pass-Through Trust	6 602	5 547	0,05	
Penske Truck Leasing Co. LP				4,125 % éch. 01/03/2048	3 755	3 052	0,03	2,700 % éch. 01/11/2033	496	438	0,00	
3,350 % éch. 01/11/2029	17 110	14 620	0,14	5,625 % éch. 01/02/2036	2 053	2 036	0,02	2,875 % éch. 07/04/2030	662	607	0,01	
Philip Morris International, Inc.				5,950 % éch. 01/02/2038	1 490	1 534	0,01	3,450 % éch. 07/01/2030	2 200	1 905	0,02	
5,625 % éch. 17/11/2029	6 800	6 934	0,07	6,650 % éch. 01/04/2029	10 800	11 191	0,11	3,500 % éch. 01/09/2031	15 443	13 954	0,13	
Physicians Realty LP				Southern California Gas Co.	5 200	9 873	0,09	3,700 % éch. 01/09/2031	5 137	4 459	0,04	
3,950 % éch. 15/01/2028	11 870	10 847	0,10	5,200 % éch. 01/06/2033	10 000	9 873	0,09	4,000 % éch. 11/10/2027	1 764	1 661	0,02	
4,300 % éch. 15/03/2027	7 400	6 973	0,07	Southern Co.				4,150 % éch. 07/01/2025	1 676	1 648	0,02	
Piedmont Natural Gas Co., Inc.				1,875 % éch. 15/09/2081	€ 2 800	2 398	0,02	4,150 % éch. 25/02/2033	9 834	9 034	0,09	
5,400 % éch. 15/06/2033	5 000	4 992	0,05	5,200 % éch. 15/06/2033	\$ 1 000	993	0,01	4,300 % éch. 15/02/2027	1 677	1 614	0,02	
Pioneer Natural Resources Co.				Southern Co. Gas Capital Corp.	11 390	8 957	0,09	4,550 % éch. 25/02/2033	976	871	0,01	
7,200 % éch. 15/01/2028	2 500	2 649	0,03	1,750 % éch. 15/01/2031	1 100	1 037	0,01	5,800 % éch. 15/07/2037	6 500	6 616	0,06	
Plains All American Pipeline LP				3,250 % éch. 15/06/2026	600	499	0,00	5,875 % éch. 15/04/2029	6 097	6 052	0,06	
6,700 % éch. 15/05/2036	300	296	0,00	4,400 % éch. 30/03/2047	1 920	1 936	0,02	UnitedHealth Group, Inc.	25 000	27 795	0,26	
Principal Life Global Funding				5,875 % éch. 15/03/2041				6,050 % éch. 15/02/2063	10 000	11 318	0,11	
3,000 % éch. 18/04/2026	5 700	5 286	0,05	Southern Power Co.	2 800	2 582	0,02	Venture Global Calcasieu Pass LLC	7 800	6 398	0,06	
Progress Energy, Inc.				5,250 % éch. 15/07/2043				3,875 % éch. 01/11/2033	39 500	39 219	0,37	
7,750 % éch. 01/03/2031	750	851	0,01	Southwest Airlines Co.	7 600	7 549	0,07	6,250 % éch. 15/01/2030				
Prologis Euro Finance LLC				5,125 % éch. 15/06/2027				Venture Global LNG, Inc.	14 700	14 946	0,14	
3,875 % éch. 31/01/2030	€ 2 100	2 224	0,02	Spirit AeroSystems, Inc.	3 850	1 116	0,01	8,125 % éch. 01/06/2028	14 500	14 638	0,14	
4,250 % éch. 31/01/2043	5 100	5 157	0,05	3,850 % éch. 15/06/2026	1 200	1 116	0,01	8,375 % éch. 01/06/2031				
Protective Life Corp.				Spirit Airlines Pass-Through Trust	4 100	2 197	0,02	Verizon Communications, Inc.	1 400	1 231	0,01	
3,400 % éch. 15/01/2030	\$ 21 300	18 534	0,18	Spirit Realty LP	4 800	4 325	0,04	2,100 % éch. 22/03/2028	736	592	0,01	
Provident Funding Associates LP				3,200 % éch. 15/01/2027	2 245	1 836	0,02	2,355 % éch. 15/03/2032	1 400	1 402	0,01	
6,375 % éch. 15/06/2025	4 100	3 623	0,03	3,200 % éch. 15/02/2031	1 000	881	0,01	5,882 % éch. 20/03/2026	6 800	6 858	0,07	
Realty Income Corp.				4,000 % éch. 15/07/2029	6 100	5 751	0,05	6,421 % éch. 15/05/2025				
2,200 % éch. 15/06/2028	5 000	4 336	0,04	4,450 % éch. 15/09/2026				VICI Properties LP	7 400	6 501	0,06	
4,875 % éch. 01/06/2026	3 471	3 435	0,03	Sprint LLC	7 875	4 314	0,04	3,875 % éch. 15/02/2029	5 200	4 869	0,05	
4,875 % éch. 06/07/2030 (b)	€ 600	652	0,01	Sprint Spectrum Co. LLC	4 738	5 119	0,05	4,250 % éch. 01/12/2026	4 200	3 863	0,04	
Regency Centers LP				5,152 % éch. 20/09/2029	5 119	5 054	0,05	4,500 % éch. 15/01/2028	2 825	2 567	0,02	
2,950 % éch. 15/09/2029	\$ 1 200	1 030	0,01	5,152 % éch. 20/09/2029	3 800	3 761	0,04	4,625 % éch. 01/12/2029	2 000	1 959	0,02	
Reliance Standard Life Global Funding				Standard Industries, Inc.	2 250 % éch. 21/11/2026	€ 14 450	14 041	0,13	5,750 % éch. 01/02/2027			
2,750 % éch. 21/01/2027	6 100	5 457	0,05	2,250 % éch. 21/11/2026				Virginia Electric and Power Co.	5 000	4 945	0,05	
Rio Oil Finance Trust				STORE Capital Corp.	2 750 % éch. 18/11/2030	\$ 2 000	1 448	0,01	5,000 % éch. 01/04/2033			
8,200 % éch. 06/04/2028	3 671	3 694	0,04	2,750 % éch. 18/11/2030				Vistra Operations Co. LLC	9 500	9 178	0,09	
9,250 % éch. 06/07/2024	1 765	1 782	0,02	4,500 % éch. 15/03/2028	800	700	0,01	3,700 % éch. 30/01/2027	8 000	7 332	0,07	
9,750 % éch. 06/01/2027	156	161	0,00	Stryker Corp.	1 950 % éch. 15/06/2030	9 650	8 066	0,08	VMware, Inc.	5 000	4 736	0,05
Rockies Express Pipeline LLC				1,950 % éch. 15/06/2030				1,000 % éch. 15/08/2024	7 900	7 495	0,07	
4,800 % éch. 15/05/2030	6 600	5 774	0,06	Sun Communities Operating LP	4 200 % éch. 15/04/2032	3 400	2 973	0,03	3,900 % éch. 21/08/2027	19 415	18 541	0,18
S&P Global, Inc.				4,200 % éch. 15/04/2032				4,700 % éch. 15/05/2030				
4,250 % éch. 01/05/2029	13 610	13 236	0,13	Synchrony Bank	7 550	7 091	0,07	Volkswagen Group of America Finance LLC	1 500	1 504	0,01	
4,750 % éch. 01/08/2028	2 600	2 586	0,02	5,625 % éch. 23/08/2027				6,040 % éch. 07/06/2024				
Sabine Pass Liquefaction LLC				Synchrony Financial	3 950 % éch. 01/12/2027	5 200	4 536	0,04	Walt Disney Co.	5 959	5 389	0,05
4,200 % éch. 15/03/2028	5 700	5 406	0,05	System Energy Resources, Inc.	2 140 % éch. 09/12/2025	17 300	15 704	0,15	2,200 % éch. 13/01/2028			
5,000 % éch. 15/03/2027	7 300	7 190	0,07	T-Mobile USA, Inc.	2 050 % éch. 15/02/2028	13 940	12 095	0,12	Warnermedia Holdings, Inc.	1 500	1 400	0,01
5,750 % éch. 15/05/2024	2 548	2 544	0,02	2,250 % éch. 15/11/2031	16 100	12 890	0,12	3,755 % éch. 15/03/2027	5 950	5 280	0,05	
Sabra Health Care LP				2,550 % éch. 15/02/2031	8 000	6 652	0,06	5,141 % éch. 15/03/2052	9 090	7 408	0,07	
3,200 % éch. 01/12/2031	4 050	3 026	0,03	3,300 % éch. 15/02/2051	2 200	1 545	0,01	WEA Finance LLC	8 000	7 558	0,07	
Sammons Financial Group, Inc.				3,875 % éch. 15/04/2030	13 200	12 169	0,12	3,750 % éch. 17/09/2024				
4,450 % éch. 12/05/2027	700	646	0,01	4,800 % éch. 15/07/2028	8 400	8 230	0,08	WEC Energy Group, Inc.	7 300	7 193	0,07	
San Diego Gas & Electric Co.				5,650 % éch. 15/01/2053	1 900	1 931	0,02	4,750 % éch. 09/01/2026				
3,750 % éch. 01/06/2047	100	78	0,00	Targa Resources Corp.	6 125 % éch. 15/03/2033	3 500	3 578	0,03	Wells Fargo & Co.	11 500	10 256	0,10
4,100 % éch. 15/06/2049	3 400	2 798	0,03	6,125 % éch. 15/03/2033				2,393 % éch. 02/06/2028	5 800	5 450	0,05	
5,350 % éch. 01/04/2053	3 075	3 053	0,03	TD SYNEX Corp.	1 750 % éch. 09/08/2026	5 950	5 190	0,05	3,196 % éch. 17/06/2027	7 000	6 524	0,06
Santander Holdings USA, Inc.				2,375 % éch. 09/08/2028	10 000	8 202	0,08	3,584 % éch. 22/05/2028				
2,490 % éch. 06/01/2028	4 600	3 977	0,04	Teachers Insurance & Annuity Association of America	4 375 % éch. 15/09/2054	18 200	17 577	0,17				
3,244 % éch. 05/10/2026	2 500	2 253	0,02									
3,500 % éch. 07/06/2024	9 500	9 228	0,09									
4,500 % éch. 17/07/2025	4 000	3 885	0,04									
SBA Tower Trust												
1,884 % éch. 15/07/2050	25 500	22 928	0,22									
2,836 % éch. 15/01/2050	7 009	6 658	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
4,000 % éch. 01/08/2053	\$ 411 400	\$ 386 443	3,68	Ameren Corp.	\$ 1 300	\$ 1 296	0,01	Republic Services, Inc.	\$ 1 300	\$ 1 299	0,01
4,500 % éch. 01/08/2053	68 600	65 990	0,63	5,400 % éch. 21/07/2023				5,250 % éch. 05/07/2023			
5,000 % éch. 01/07/2053	101 200	99 184	0,94	American Electric Power Co., Inc.	7 500	7 489	0,07	S&P Global, Inc.	3 600	3 597	0,04
		671 151	6,39	5,430 % éch. 10/07/2023	5 800	5 772	0,06	5,400 % éch. 06/07/2023			
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				5,480 % éch. 01/08/2023	6 800	6 753	0,07	Sempra Energy	300	300	0,00
Obligations du Trésor américain				5,480 % éch. 14/08/2023				5,400 % éch. 05/07/2023			
1,375 % éch. 15/11/2040	149 120	99 887	0,95	AT+T, Inc.	5 700	5 633	0,29	Thomson Reuters Corp.	11 900	11 879	0,11
1,750 % éch. 15/08/2041	81 800	57 528	0,55	5,700 % éch. 19/03/2024	32 000	30 633	0,29	5,470 % éch. 12/07/2023	5 700	5 689	0,05
1,875 % éch. 15/02/2041	297 100	215 989	2,06	Becton Dickinson and Co.	5 390	5 390	0,03	5,470 % éch. 13/07/2023	6 900	6 882	0,07
1,875 % éch. 15/11/2051	66 350	43 827	0,42	5,390 % éch. 10/07/2023	3 100	3 096	0,03	5,470 % éch. 18/07/2023	500	499	0,01
2,000 % éch. 15/11/2041	189 400	138 773	1,32	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	5 420	5 378	0,08	5,500 % éch. 28/07/2023	4 200	4 188	0,04
2,250 % éch. 15/05/2041	68 000	52 425	0,50	5,420 % éch. 17/07/2023	8 600	8 578	0,08	5,500 % éch. 19/07/2023			
2,250 % éch. 15/08/2046	220	161	0,00	5,610 % éch. 25/07/2023	3 400	3 387	0,03	VW Credit, Inc.	5 800	5 782	0,06
2,375 % éch. 15/02/2042	53 700	41 834	0,40	5,590 % éch. 03/07/2023	3 300	3 299	0,03	5,400 % éch. 21/07/2023	800	797	0,01
2,500 % éch. 15/02/2045	28 750	22 274	0,21	5,590 % éch. 05/07/2023	2 000	1 998	0,02	5,400 % éch. 26/07/2023	300	299	0,00
2,750 % éch. 15/11/2047	1 133	912	0,01	5,600 % éch. 11/07/2023	250	250	0,00	5,400 % éch. 28/07/2023			
2,875 % éch. 15/11/2046	1 461	1 205	0,01	5,610 % éch. 11/07/2023	250	250	0,00	Walgreens Boots Alliance	7 800	7 794	0,08
2,875 % éch. 15/05/2049	6 555	5 423	0,05	Dominion Resources, Inc.	600	600	0,01	6,000 % éch. 05/07/2023			
3,000 % éch. 15/05/2045	32 725	27 661	0,27	5,400 % éch. 03/07/2023	400	399	0,00	Total des Instruments à court terme		187 981	1,79
3,000 % éch. 15/02/2048	40 992	34 587	0,33	5,400 % éch. 19/07/2023				Total des Valeurs mobilières	\$ 9 186 690		87,55
3,125 % éch. 15/08/2044	25 700	22 253	0,21	Duke Energy Corp.	5 400 % éch. 10/07/2023	4 500	4 493	0,04	ACTIONS		
3,125 % éch. 15/05/2048	29 360	25 347	0,24	Électricité de France S.A.	5 050	5 023	0,05	FONDS D'INVESTISSEMENT			
3,250 % éch. 15/05/2042	141 316	126 174	1,20	5,510 % éch. 04/08/2023	6 600	6 564	0,06	ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
3,375 % éch. 15/08/2042	2 000	1 816	0,02	Enbridge, Inc.	3 300	3 294	0,03	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (h)			
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (f)				5,440 % éch. 12/07/2023	7 200	7 178	0,07	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)			
1,500 % éch. 15/02/2053	96 589	93 868	0,89	5,440 % éch. 20/07/2023	250	249	0,00	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (h)			
Billets du Trésor américain	206 000	204 016	1,94	5,470 % éch. 14/07/2023	700	698	0,01	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)			
3,875 % éch. 30/09/2029	460	461	0,01	5,470 % éch. 20/07/2023				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (h)			
4,625 % éch. 15/03/2026				Enel Finance America LLC	4 700	4 696	0,05	Total des Fonds d'investissement			
STRIPS du Trésor américain				5,450 % éch. 06/07/2023	900	897	0,01	\$ 1 057 482			
0,000 % éch. 15/05/2043	25	11	0,00	5,450 % éch. 26/07/2023	300	299	0,00	10,08			
(e)				Energy Corp.	5 380 % éch. 14/07/2023	1 900	1 896	0,02			
		1 216 432	11,59	5,380 % éch. 14/07/2023	1 900	1 896	0,02				
ACTIONS				5,450 % éch. 20/07/2023	1 000	997	0,01				
BONS DE SOUSCRIPTION				Humana, Inc.	5,450 % éch. 19/07/2023	1 200	1 197	0,01			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060	7 228	0	0,00	J.M. Smucker Co.	5,410 % éch. 17/07/2023	1 400	1 396	0,01			
Total États-Unis		5 450 372	51,94	5,450 % éch. 12/07/2023	4 400	4 392	0,04				
VALEUR NOMINALE (en milliers)				Leidos, Inc.	5,900 % éch. 10/07/2023	10 200	10 184	0,10			
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES				Marriott International, Inc.	5,400 % éch. 04/08/2023	700	696	0,01			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				McCormick & Co., Inc.	5,350 % éch. 25/07/2023	300	299	0,00			
Champion Path Holdings Ltd.				Mondelez International, Inc.	5,370 % éch. 24/07/2023	750	747	0,01			
4,500 % éch. 27/01/2026	\$ 9 900	8 753	0,08	5,370 % éch. 25/07/2023	750	747	0,01				
4,850 % éch. 27/01/2028	13 700	11 097	0,11	5,430 % éch. 13/07/2023	1 300	1 298	0,01				
CLP Power Hong Kong Financing Ltd.				5,430 % éch. 14/07/2023	1 300	1 297	0,01				
2,125 % éch. 30/06/2030	16 900	14 041	0,13	Penske Truck Leasing Co. LP	5,350 % éch. 11/07/2023	4 600	4 593	0,04			
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.				5,350 % éch. 14/07/2023	250	249	0,00				
6,125 % éch. 15/05/2029	3 800	3 847	0,04	Quanta Services, Inc.	5,900 % éch. 05/07/2023	250	250	0,00			
JMH Co. Ltd.				5,900 % éch. 11/07/2023	250	250	0,00				
2,500 % éch. 09/04/2031	4 900	4 109	0,04								
Total Îles Vierges britanniques		41 847	0,40								
INSTRUMENTS À COURT TERME											
BILLETS DE TRÉSORERIE											
Amcor PLC											
5,430 % éch. 13/07/2023	300	299	0,00								
5,450 % éch. 10/07/2023	600	599	0,01								
5,450 % éch. 11/07/2023	400	399	0,00								

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
BRC	5,120 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 472 200	Obligations du Trésor américain 3,875 % - 4,625 % échéance 30/04/2025 - 30/06/2025	\$ (481 979)	\$ 472 200	\$ 472 401	4,50
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	57 832	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	(58 989)	57 832	57 844	0,55
	5,010	30/06/2023	03/07/2023	21 500	Billets du Trésor américain 3,500 % échéance 30/04/2028	(21 930)	21 500	21 500	0,20
SAL	5,100	30/06/2023	03/07/2023	8 000	Billets du Trésor américain 0,250 % échéance 31/10/2025	(8 161)	8 000	8 003	0,08
Total des Contrats de mise en pension						\$ (571 059)	\$ 559 532	\$ 559 748	5,33

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit 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	836	\$ (1 329)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Long	09/2023	8	(14)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Long	09/2023	455	464	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Long	09/2023	3 648	(5 734)	(0,06)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Long	09/2023	15	33	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Long	09/2023	2 163	(1 530)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	205	(194)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	306	286	0,00
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Long	09/2023	598	(343)	0,00
				<u>\$ (8 361)</u>	<u>(0,08)</u>

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	252	\$ (110)	\$ (95)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	252	(88)	(12)	0,00
Option de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	123,000	21/07/2023	72	(28)	(11)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	131,000	21/07/2023	72	(37)	(14)	0,00
				<u>\$ (263)</u>	<u>\$ (132)</u>	<u>0,00</u>
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					<u>\$ (8 493)</u>	<u>(0,08)</u>

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
Toll Brothers Finance Corp.	(1,000) %	20/06/2024	\$ 23 500	\$ (152)	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 ⁽²⁾	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AES Corp.	5,000 %	20/12/2025	\$ 7 900	\$ (781)	(0,01)
AES Corp.	5,000	20/06/2026	2 400	(217)	0,00
Airbus Finance BV	1,000	20/12/2025	€ 10 300	27	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20/12/2027	\$ 8 000	137	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2023	12 100	(119)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	3 400	16	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2024	7 600	(86)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2025	2 000	(11)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	54 000	(482)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2026	1 300	(12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	29 600	208	0,00
Atlantia SpA	1,000	20/12/2025	€ 1 800	75	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2025	\$ 7 000	156	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2025	900	22	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2026	1 000	15	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20/12/2025	€ 6 800	(22)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2024	23 900	(26)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2025	6 000	15	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2027	500	7	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/06/2028	20 400	(48)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2028	1 100	0	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2024	\$ 5 000	(304)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	32 050	268	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2024	27 900	555	0,01
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	18 750	(10)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	2 000	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20/12/2026	2 050	(165)	0,00
General Motors Co.	5,000	20/06/2028	2 435	53	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20/06/2028	€ 2 700	10	0,00
Hess Corp.	1,000	20/06/2026	\$ 7 000	100	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20/12/2023	6 100	(792)	(0,01)
Lennar Corp.	5,000	20/12/2026	3 200	(223)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20/12/2023	11 000	346	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20/06/2028	600	10	0,00

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel ⁽¹⁾	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000 %	20/06/2026	\$ 11 300	\$ (98)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2024	€ 25 300	(222)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	9 000	(58)	0,00
Southwest Airlines Co.	1,000	20/12/2026	\$ 3 100	40	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20/06/2028	7 800	22	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20/06/2028	€ 24 800	(45)	0,00
Tesco PLC	1,000	20/12/2024	63 700	761	0,01
Tesco PLC	1,000	20/12/2027	4 700	39	0,00
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	7 300	(23)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2026	\$ 1 900	(29)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	500	11	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2028	11 700	47	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20/06/2024	€ 12 700	(65)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20/12/2026	4 100	(77)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20/06/2028	11 100	(167)	0,00
				\$ (1 142)	(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 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	\$ 89 300	\$ 824	0,01
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	903 500	6 634	0,06
Indice iTraxx Crossover 39 à 5 ans	5,000	20/06/2028	€ 12 100	416	0,01
				\$ 7 874	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	\$ (4 109)	(0,04)
À payer ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	72 000	(2 788)	(0,03)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2023	¥ 910 000	9	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/09/2024	1 829 900	9	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,300	20/03/2028	1 192 900	0	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	\$ 160 000	11 897	0,11
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	427 700	10 167	0,10
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	CAD 244 800	(17 861)	(0,17)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	17/03/2053	€ 88 530	41 610	0,40
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,175	17/03/2033	265 610	(70 613)	(0,67)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	31 200	(1 394)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	88 900	(9 442)	(0,09)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	20 800	(2 180)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	62 700	(5 881)	(0,06)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	28 000	(2 625)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	24 000	(533)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	76 300	663	0,01
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,000	19/09/2023	HUF 37 770 400	(6 154)	(0,06)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,250	19/09/2023	16 157 700	(3 275)	(0,03)
					\$ (62 500)	(0,60)
					\$ (55 920)	(0,53)

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.

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit 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

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	3,380 %	31/07/2023	11 400	\$ (44)	\$ (54)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	11 400	(44)	(34)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	7 900	(52)	(20)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	7 900	(52)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,060	14/07/2023	4 300	(31)	(19)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,360	14/07/2023	4 300	(31)	(10)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	5 400	(17)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	5 400	(17)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	4 400	(30)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	4 400	(30)	0	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	4 300	(14)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	4 300	(14)	(21)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	5 300	(12)	(10)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	5 300	(12)	(19)	0,00
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	4 600	(32)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	4 600	(32)	0	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	4 400	(14)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	4 400	(14)	(21)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	5 200	(12)	(10)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	5 200	(12)	(18)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	5 500	(20)	(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	10/07/2023	5 500	(20)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,250	20/07/2023	12 200	(42)	(16)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	12 200	(42)	(51)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	5 400	(17)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	5 400	(17)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	5 400	(19)	(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	10/07/2023	5 400	(19)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	5 400	(18)	(10)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	5 400	(18)	(22)	0,00
							\$ (748)	\$ (381)	(0,01)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security TBA 4,500 % éch. 01/08/2053	\$ 95,875	07/08/2023	14 300	\$ (85)	\$ (84)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security TBA 4,500 % éch. 01/08/2053	97,875	07/08/2023	14 300	(78)	(20)	0,00
					\$ (163)	\$ (104)	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/(recues)	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)	\$ 43	\$ 5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2024	14 500	(304)	435	131	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	14 200	(395)	568	173	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2024	13 500	(294)	416	122	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/12/2024	22 100	93	189	282	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	62 700	(1 024)	1 821	797	0,01
CBK	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/12/2025	7 800	170	(68)	102	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2024	31 400	(1 186)	1 046	(140)	0,00
	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 3 000	286	(491)	(205)	0,00
DUB	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	\$ 11 100	(270)	406	136	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	5 700	(5)	81	76	0,00
GLM	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	44 900	(502)	1 235	733	0,01
GST	Equinix, Inc.	5,000	20/06/2027	4 500	629	(52)	577	0,01
	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 15 100	1 697	(2 727)	(1 030)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	\$ 5 700	(7)	83	76	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/12/2026	1 400	33	(8)	25	0,00
JLN	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2024	5 700	(229)	204	(25)	0,00
	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 5 000	560	(901)	(341)	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20/12/2024	\$ 4 400	(99)	63	(36)	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/06/2024	16 300	223	(106)	117	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/12/2024	8 100	112	(35)	77	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	7 600	(1)	103	102	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2027	15 800	(978)	811	(167)	0,00
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20/06/2025	7 900	0	(63)	(63)	0,00
	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	1,000	20/12/2024	16 500	322	(119)	203	0,00
	Pioneer Natural Resources Co.	1,000	20/06/2025	8 400	(408)	520	112	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 2 700	311	(495)	(184)	0,00
					\$ (1 304)	\$ 2 959	\$ 1 655	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
BPS	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000 %	20/12/2023	\$ 5 80	\$ 676	\$ (532)	\$ 144	0,00
BRC	Indice iTraxx Japan 39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	¥ 13 027 00	499	755	1 254	0,01
CBK	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	\$ 8 00	828	(629)	199	0,00
GST	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	24 00	2 849	(2 253)	596	0,01
JPM	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	44 30	5 450	(4 349)	1 101	0,01
	Indice iTraxx Japan 39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	¥ 4 024 00	108	279	387	0,01
MYC	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	\$ 6 60	784	(620)	164	0,00
					\$ 11 194	\$ (7 349)	\$ 3 845	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
AZD	07/2023	AUD	\$ 2 061	\$ 1 349	\$ 0	\$ (23)	0,00
	07/2023	\$	7 525	AUD 11 340	23	0	0,00
	08/2023	AUD	11 340	\$ 7 531	0	(23)	0,00
BOA	07/2023		19 171	12 507	0	(254)	0,00
	07/2023	CAD	194 652	143 054	0	(4 047)	(0,04)
	07/2023	DKK	39 871	5 758	0	(85)	0,00
	07/2023	£	1 232	1 558	0	(8)	0,00
	07/2023	\$	10 635	DKK 72 307	0	(40)	0,00
	07/2023		33 407	€ 30 900	316	(11)	0,00
	07/2023		53 907	¥ 7 498 900	0	(2 024)	(0,02)
	07/2023		30 438	MXN 560 360	2 153	0	0,02
	08/2023	DKK	72 186	\$ 10 635	40	0	0,00
	09/2023	INR	959	12	0	0	0,00
	09/2023	KRW	76 331	60	2	2	0,00
	09/2023	\$	4 348	IDR 65 090 309	0	(25)	0,00
BPS	07/2023	€	1 318 551	\$ 1 417 573	0	(20 968)	(0,20)
	07/2023	\$	5 370	AUD 8 107	27	0	0,00
	07/2023		174	CHF 156	0	0	0,00
	07/2023		52 119	€ 47 721	5	(60)	0,00
	07/2023		49 940	¥ 6 941 546	0	(1 913)	(0,02)
	07/2023		7 308	MXN 130 668	298	0	0,00
	08/2023	AUD	8 107	\$ 5 374	0	(27)	0,00
	08/2023	CHF	155	174	0	0	0,00
	08/2023	\$	55 207	¥ 7 932 000	24	0	0,00
	08/2023	ZAR	137 691	\$ 7 416	157	0	0,00
	09/2023	\$	4 509	IDR 67 761 328	0	(8)	0,00
	09/2023		890	PEN 3 258	3	0	0,00
	10/2023	ZAR	263 125	\$ 14 135	353	0	0,00
	12/2023	\$	1 134	MXN 20 219	10	0	0,00
BRC	07/2023	PEN	50 187	\$ 13 718	0	(128)	0,00
	07/2023	\$	21 192	£ 16 801	185	(17)	0,00
	07/2023		13 711	PEN 50 187	127	0	0,00
	08/2023	CLP	78 489	\$ 96	0	(1)	0,00
	08/2023	\$	30 801	COP 131 218 774	236	0	0,00
	08/2023	ZAR	286 354	\$ 15 180	191	(105)	0,00
	09/2023	IDR	163 629	11	0	0	0,00
	09/2023	PEN	376 007	102 259	0	(851)	(0,01)
BSH	09/2023	\$	7 552	PEN 27 887	99	0	0,00
CBK	07/2023	AUD	7 159	\$ 4 671	0	(95)	0,00
	07/2023	\$	8 847	€ 8 181	84	(6)	0,00
	07/2023		9 735	£ 7 675	22	0	0,00
	07/2023		7 308	MXN 130 664	297	0	0,00
	07/2023		59 488	PEN 223 029	2 007	0	0,02
	08/2023	CLP	18 085 756	\$ 22 033	0	(351)	0,00
	08/2023	CNH	101	14	1	0	0,00
	08/2023	SEK	1 637	161	10	0	0,00
	08/2023	\$	22 200	CLP 18 164 245	281	0	0,00
	08/2023		8 714	NOK 90 901	0	(217)	0,00
	10/2023		1 548	CLP 1 268 928	15	0	0,00
CLY	07/2023	DKK	117 175	\$ 16 913	0	(255)	0,00
	08/2023	\$	9 838	NOK 103 111	0	(199)	0,00
DUB	07/2023		525	BRL 2 842	65	0	0,00
	07/2023		16 206	£ 12 998	319	0	0,00
	09/2023	PEN	544	\$ 148	0	(1)	0,00
	10/2023	ZAR	110 471	6 066	279	0	0,00
FAR	07/2023	PEN	54 587	14 998	0	(50)	0,00
	08/2023	\$	14 998	PEN 54 743	43	0	0,00
GLM	07/2023	BRL	70 572	\$ 14 616	0	(14)	0,00

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	
	07/2023	\$	12 533 BRL	67 506	\$ 1 461	\$ 0	\$ 1 461	0,02
	07/2023		2 569 PEN	9 379	15	0	15	0,00
	08/2023		3 831 NOK	40 652	0	(31)	(31)	0,00
	09/2023	BRL	14 376 \$	2 854	0	(93)	(93)	0,00
	09/2023	\$	14 616 BRL	71 354	11	0	11	0,00
	09/2023		5 177 PEN	18 922	12	0	12	0,00
JPM	07/2023	AUD	15 930 \$	10 415	0	(189)	(189)	0,00
	07/2023	£	4 810	6 081	0	(33)	(33)	0,00
	07/2023	¥	4 917 636	34 387	363	0	363	0,00
	07/2023	\$	1 577 CAD	2 092	4	0	4	0,00
	07/2023		1 328 758 €	1 217 147	235	(1 085)	(850)	(0,01)
	07/2023		798 MXN	14 030	19	0	19	0,00
	08/2023	€	1 206 366 \$	1 319 073	1 126	0	1 126	0,01
	08/2023	HUF	7 853 166	22 608	41	(120)	(79)	0,00
	08/2023	\$	6 082 £	4 810	33	0	33	0,00
	08/2023		34 387 ¥	4 896 739	0	(364)	(364)	0,00
	08/2023		888 MXN	15 390	2	0	2	0,00
	08/2023		1 413 NOK	14 990	0	(12)	(12)	0,00
	08/2023		1 308 ZAR	23 940	0	(46)	(46)	0,00
	08/2023	ZAR	134 \$	7	0	0	0	0,00
	09/2023	\$	1 818 IDR	27 350 116	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023		17 251 INR	1 421 764	31	0	31	0,00
	09/2023		4 619 PEN	16 901	18	0	18	0,00
MBC	07/2023	CAD	3 656 \$	2 741	0	(22)	(22)	0,00
	07/2023	€	22 076	23 676	0	(409)	(409)	0,00
	07/2023	£	275 719	341 314	0	(9 222)	(9 222)	(0,09)
	07/2023	\$	1 647 CAD	2 232	40	0	40	0,00
	07/2023		25 247 €	23 435	321	0	321	0,00
	09/2023	KRW	141 506 \$	111	3	0	3	0,00
MYI	07/2023	€	1 008	1 099	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	£	80	101	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	IDR	17 158 597	1 147	3	0	3	0,00
	07/2023	SGD	71	53	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	111 CHF	99	0	0	0	0,00
	07/2023		9 453 DKK	64 485	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023		15 606 €	14 430	137	0	137	0,00
	07/2023		32 574 £	26 082	587	(2)	585	0,01
	07/2023		1 142 IDR	17 158 597	2	0	2	0,00
	07/2023		2 SEK	23	0	0	0	0,00
	08/2023	DKK	64 377 \$	9 453	5	0	5	0,00
	08/2023	\$	2 251 ZAR	41 194	0	(79)	(79)	0,00
	09/2023	KRW	159 031 \$	124	3	0	3	0,00
	09/2023	\$	4 518 IDR	67 514 158	0	(34)	(34)	0,00
	09/2023		3 723 INR	307 093	10	0	10	0,00
RBC	07/2023	MXN	16 241 \$	844	0	(101)	(101)	0,00
	08/2023	\$	5 183 MXN	89 828	12	0	12	0,00
SCX	07/2023	AUD	22 487 \$	14 694	0	(274)	(274)	0,00
	07/2023	CHF	164	182	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$	11 057 AUD	16 657	30	0	30	0,00
	08/2023	AUD	16 657 \$	11 066	0	(30)	(30)	0,00
	09/2023	\$	16 887 IDR	252 117 291	0	(140)	(140)	0,00
	09/2023		10 796 INR	889 196	12	0	12	0,00
	09/2023		10 260 PEN	37 754	98	0	98	0,00
SOG	07/2023	AUD	13 613 \$	8 906	0	(155)	(155)	0,00
	07/2023	PLN	1 619	376	0	(22)	(22)	0,00
SSB	07/2023	PEN	104 373	28 615	0	(164)	(164)	0,00
	08/2023	\$	28 575 PEN	104 373	147	0	147	0,00
TOR	07/2023	AUD	7 204 \$	4 712	0	(84)	(84)	0,00
	07/2023	\$	13 539 AUD	20 498	106	0	106	0,00
	07/2023		148 194 CAD	196 089	102	(108)	(6)	0,00
	07/2023		287 423 £	226 192	147	0	147	0,00
	08/2023	AUD	20 498 \$	13 550	0	(105)	(105)	0,00
	08/2023	CAD	196 011	148 194	107	(102)	5	0,00
	08/2023	£	226 192	287 485	0	(142)	(142)	0,00
	10/2023	CLP	1 268 928	1 540	0	(23)	(23)	0,00
UAG	07/2023	AUD	1 649	1 079	0	(18)	(18)	0,00
	07/2023	\$	21 815 AUD	32 669	46	(114)	(68)	0,00
	07/2023		138 MXN	2 464	5	0	5	0,00
	08/2023	AUD	32 669 \$	21 832	114	(46)	68	0,00
	08/2023	ZAR	180 831	9 421	3	(113)	(110)	0,00
	09/2023		185 425	10 576	828	0	828	0,01
	10/2023		35 601	1 923	58	0	58	0,00
					\$ 13 969	\$ (45 297)	\$ (31 328)	(0,30)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD 851	\$ 565	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07/2023	\$ 1 067	AUD 1 630	18	0	18	0,00
	08/2023	565	851	2	0	2	0,00
BOA	07/2023	AUD 17	\$ 11	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 3 319	AUD 5 106	80	0	80	0,00
BPS	07/2023	AUD 4 482	\$ 2 967	0	(16)	(16)	0,00
	07/2023	\$ 2 769	AUD 4 268	72	0	72	0,00
	08/2023	2 883	4 349	14	0	14	0,00
CBK	07/2023	914	1 383	14	(7)	7	0,00
	07/2023	AUD 75	\$ 49	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	1 501	996	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$ 821	AUD 1 256	15	0	15	0,00
SCX	08/2023	997	1 501	3	0	3	0,00
	07/2023	AUD 5 197	\$ 3 453	8	(15)	(7)	0,00
UAG	07/2023	\$ 1 269	AUD 1 939	21	0	21	0,00
	08/2023	3 357	5 052	15	(6)	9	0,00
				\$ 262	\$ (49)	\$ 213	0,00

Au 30 juin 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, Investisseurs en CHF (couverte) de distribution, Administrations en CHF (couverte) de capitalisation, 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
BOA	07/2023	CHF 186	\$ 208	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 19	CHF 17	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	CHF 209 112	\$ 233 815	79	0	79	0,00
	07/2023	\$ 318 182	CHF 287 839	3 552	0	3 552	0,03
	08/2023	233 815	208 517	0	(79)	(79)	0,00
CLY	07/2023	CHF 110 524	\$ 123 042	0	(496)	(496)	0,00
	08/2023	\$ 123 042	CHF 110 209	496	0	496	0,00
	07/2023	CHF 75	\$ 83	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07/2023	2 354	2 623	0	(8)	(8)	0,00
	07/2023	\$ 181	CHF 163	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	CHF 9 715	\$ 10 745	0	(115)	(115)	0,00
	07/2023	\$ 4 647	CHF 4 201	49	0	49	0,00
RBC	07/2023	CHF 113	\$ 127	0	0	0	0,00
RYL	07/2023	49	55	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	1 132	1 253	0	(13)	(13)	0,00
	07/2023	\$ 222 524	CHF 199 944	964	0	964	0,01
	07/2023	CHF 216 943	\$ 242 011	0	(478)	(478)	0,00
UAG	07/2023	\$ 200 590	CHF 180 239	873	0	873	0,01
	08/2023	241 279	215 670	475	0	475	0,00
				\$ 6 488	\$ (1 190)	\$ 5 298	0,05

Au 30 juin 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
BPS	07/2023	\$ 3 719	CZK 81 931	\$ 44	\$ 0	\$ 44	0,00
DUB	07/2023	3 758	83 597	81	0	81	0,00
	07/2023	CZK 82 828	\$ 3 818	15	0	15	0,00
MYI	07/2023	\$ 39	CZK 872	1	0	1	0,00
	08/2023	3 818	82 930	0	(15)	(15)	0,00
UAG	07/2023	3 702	81 871	58	0	58	0,00
				\$ 199	\$ (15)	\$ 184	0,00

Au 30 juin 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	07/2023	AUD 401	\$ 266	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$ 119	AUD 182	2	0	2	0,00
	08/2023	266	401	1	0	1	0,00
BOA	07/2023	€ 53	\$ 57	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	¥ 56	0	0	0	0	0,00
	07/2023	SEK 662	61	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 148	AUD 229	4	0	4	0,00
	07/2023	4 906	CAD 6 676	139	0	139	0,00
	07/2023	0	€ 0	0	0	0	0,00

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
	07/2023	\$	27	NZD 45	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023		1	SEK 13	0	0	0,00
	08/2023		61	661	0	0	0,00
BPS	07/2023	AUD	287	\$ 190	0	(1)	0,00
	07/2023	CHF	626	699	0	0	0,00
	07/2023	€	44 525	48 786	209	0	0,00
	07/2023	\$	77	€ 70	0	0	0,00
	07/2023		1 020	¥ 141 786	0	(39)	0,00
	07/2023		2	NZD 4	0	0	0,00
	08/2023		190	AUD 287	1	0	0,00
	08/2023		699	CHF 624	0	0	0,00
	08/2023		48 832	€ 44 505	0	(211)	0,00
CBK	07/2023	€	52	\$ 57	0	0	0,00
	07/2023	\$	604	€ 562	10	0	0,00
CLY	07/2023	CHF	16	\$ 18	0	0	0,00
	08/2023	\$	18	CHF 16	0	0	0,00
JPM	07/2023	¥	48 265	\$ 337	3	0	0,00
	08/2023	\$	337	¥ 48 060	0	(4)	0,00
MBC	07/2023	€	145	\$ 156	0	(2)	0,00
	07/2023	£	157	196	0	(4)	0,00
	07/2023	\$	3	CAD 3	0	0	0,00
	07/2023		217	€ 199	2	(1)	0,00
	07/2023		8 147	£ 6 582	220	0	0,00
MYI	07/2023		9	CHF 8	0	0	0,00
	07/2023		60	SEK 648	0	0	0,00
SCX	07/2023	AUD	589	\$ 391	0	(1)	0,00
	07/2023	\$	678	CHF 610	3	0	0,00
	07/2023		71	NZD 116	1	0	0,00
	08/2023		391	AUD 589	1	0	0,00
SOG	07/2023		787	1 203	14	0	0,00
	07/2023		47 357	€ 44 023	672	0	0,01
TOR	07/2023	AUD	725	\$ 479	0	(4)	0,00
	07/2023	CAD	4 733	3 566	0	(11)	0,00
	07/2023	£	6 425	8 164	0	(4)	0,00
	07/2023	NZD	165	100	0	(1)	0,00
	07/2023	\$	416	AUD 637	7	0	0,00
	08/2023		479	725	4	0	0,00
	08/2023		3 566	CAD 4 731	11	0	0,00
	08/2023		8 165	£ 6 425	4	0	0,00
	08/2023		100	NZD 165	1	0	0,00
UAG	07/2023	AUD	395	\$ 261	0	(2)	0,00
	07/2023	\$	95	AUD 146	2	0	0,00
	07/2023		44	CHF 40	0	0	0,00
	08/2023		261	AUD 395	2	0	0,00
				\$ 1 313	\$ (287)	\$ 1 026	0,01

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$	787 948	€ 733 130	\$ 11 902	\$ (4)	0,11
BPS	07/2023	€	725 158	\$ 794 516	3 380	(12)	0,03
	07/2023	\$	792 262	€ 736 861	11 671	(17)	0,11
	08/2023		789 286	719 338	0	(3 414)	(0,03)
CBK	07/2023	€	744 782	\$ 809 419	2	(3 140)	(0,03)
	07/2023	\$	2 709	€ 2 476	0	(7)	0,00
	08/2023		776 143	712 885	2 681	0	0,02
JPM	07/2023	€	720 167	\$ 786 351	648	0	0,01
	07/2023	\$	33 791	€ 31 605	690	0	0,01
	08/2023		787 450	720 167	0	(672)	(0,01)
MBC	07/2023	€	45 147	\$ 48 387	0	(868)	(0,01)
	07/2023	\$	5 346	€ 4 975	83	(2)	0,00
SOG	07/2023		785 082	729 807	11 138	0	0,11
				\$ 42 195	\$ (8 136)	\$ 34 059	0,32

Au 30 juin 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) 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	07/2023	£	438	\$ 556	\$ 0	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$	127	£ 101	1	0	0,00
BPS	07/2023		449 439	362 179	11 351	(333)	0,11
BRC	07/2023	£	2 759	\$ 3 482	1	(27)	0,00
	07/2023	\$	1 772	£ 1 423	38	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	07/2023	£ 8 694	\$ 10 947	\$ 8	\$ (115)	\$ (107)	0,00
	07/2023	\$ 332	£ 263	3	0	3	0,00
JPM	07/2023	£ 335 315	\$ 423 972	0	(2 332)	(2 332)	(0,02)
	08/2023	\$ 424 062	£ 335 315	2 326	0	2 326	0,02
MBC	07/2023	403 500	325 955	10 903	(1)	10 902	0,10
MYI	07/2023	403 575	324 714	9 251	0	9 251	0,09
TOR	07/2023	£ 335 832	\$ 426 741	0	(218)	(218)	0,00
	08/2023	\$ 426 834	£ 335 832	211	0	211	0,00
				\$ 34 093	\$ (3 027)	\$ 31 066	0,30

Au 30 juin 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	07/2023	NOK 9	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 9 141	NOK 100 865	274	0	274	0,00
BPS	07/2023	NOK 68 609	\$ 6 382	0	(22)	(22)	0,00
	08/2023	\$ 6 382	NOK 68 542	22	0	22	0,00
CBK	07/2023	NOK 3 596	\$ 324	0	(12)	(12)	0,00
	07/2023	\$ 7 814	NOK 87 875	388	0	388	0,01
GLM	07/2023	NOK 72 566	\$ 6 733	0	(41)	(41)	0,00
	08/2023	\$ 6 733	NOK 72 495	41	0	41	0,00
RYL	07/2023	NOK 85	\$ 8	0	0	0	0,00
UAG	07/2023	\$ 6 967	NOK 77 091	229	0	229	0,00
				\$ 954	\$ (75)	\$ 879	0,01

Au 30 juin 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	07/2023	SEK 1 368 269	\$ 126 957	\$ 299	\$ (19)	\$ 280	0,00
	07/2023	\$ 33	SEK 349	0	0	0	0,00
	08/2023	93 646	1 009 361	0	(80)	(80)	0,00
BPS	07/2023	SEK 158 850	\$ 14 853	146	0	146	0,00
BRC	07/2023	\$ 1	SEK 6	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	67 716	739 603	758	0	758	0,01
GLM	07/2023	SEK 78	\$ 7	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 75	SEK 812	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	SEK 2 767	\$ 257	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 75 531	SEK 813 436	0	(222)	(222)	0,00
MYI	07/2023	SEK 1 011 051	\$ 93 646	41	0	41	0,00
	07/2023	\$ 108 693	SEK 1 166 772	0	(671)	(671)	(0,01)
	08/2023	93 646	1 009 796	0	(40)	(40)	0,00
SCX	07/2023	SEK 893	\$ 83	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 75 863	SEK 820 568	106	0	106	0,00
				\$ 1 352	\$ (1 032)	\$ 320	0,00

Au 30 juin 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	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	07/2023	\$ 28 844	SGD 39 030	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
GLM	07/2023	SGD 83	\$ 62	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 7 120	SGD 9 560	0	(56)	(56)	0,00
JPM	07/2023	SGD 42 389	\$ 31 325	3	0	3	0,00
	07/2023	\$ 3 692	SGD 4 997	0	0	0	0,00
	08/2023	31 325	42 348	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07/2023	26 484	35 783	0	(43)	(43)	0,00
	08/2023	SGD 198	\$ 146	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	41 538	30 739	48	(1)	47	0,00
	08/2023	\$ 30 021	SGD 40 527	0	(45)	(45)	0,00
UAG	07/2023	SGD 202	\$ 150	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 28 154	SGD 38 086	0	(12)	(12)	0,00
				\$ 52	\$ (164)	\$ (112)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 46 620 0,44

Total des Investissements

\$ 10 785 911 102,79

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (293 060) (2,79)

Actifs nets

\$ 10 492 851 100,00

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit 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) 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 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	\$ 25 025	\$ 20 619	0,20
Morgan Stanley	0,000	02/04/2032	11/02/2020	41 043	29 310	0,28
Oracle Corp.	4,100	25/03/2061	24/03/2021 - 26/03/2021	6 835	4 877	0,05
Oracle Corp.	6,250	09/11/2032	07/11/2022	14 476	15 398	0,15
				\$ 87 379	\$ 70 204	0,68

Un montant en numéraire de 179 611 \$ (31 décembre 2022 : 213 307 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 590 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 4 048 \$) 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 30 juin 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 30 juin 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	\$ 9 173 458	\$ 13 232	\$ 9 186 690
Fonds d'investissement	1 057 482	0	0	1 057 482
Contrats de mise en pension	0	559 532	0	559 532
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(7 125)	(10 668)	0	(17 793)
Totaux	\$ 1 050 357	\$ 9 722 322	\$ 13 232	\$ 10 785 911

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ (3)	\$ 0	\$ (3)	\$ 32	\$ 0	\$ 32
BOA	8 777	(6 280)	2 497	5 200	(5 790)	(590)
BOM	S/O	S/O	S/O	360	(470)	(110)
BPS	4 436	(840)	3 596	(21 024)	20 550	(474)
BRC	2 002	(2 040)	(38)	977	0	977
BSH	99	0	99	(11)	0	(11)
CBK	2 761	(2 470)	291	36 530	(37 360)	(830)
CLY	S/O	S/O	S/O	24	0	24
DUB	819	(570)	249	(3 383)	3 210	(173)
FAR	(7)	0	(7)	S/O	S/O	S/O
FBF	S/O	S/O	S/O	189	(250)	(61)
GLM	1 980	(1 830)	150	(8 272)	8 408	136
GST	219	(210)	9	1 037	(1 030)	7
IND	(454)	510	56	S/O	S/O	S/O
JLN	(341)	0	(341)	(237)	0	(237)
JPM	2 357	(2 020)	337	(9 156)	8 080	(1 076)
MBC	769	0	769	20 345	(19 090)	1 255
MYC	206	(260)	(54)	(594)	630	36
MYI	8 959	(5 090)	3 869	(342)	280	(62)
RBC	(89)	80	(9)	236	(350)	(114)
RYL	S/O	S/O	S/O	14	0	14
SAL	(104)	0	(104)	(90)	0	(90)
SCX	772	0	772	(14 373)	13 840	(533)
SOG	11 647	(8 600)	3 047	(88)	30	(58)
SSB	(17)	0	(17)	S/O	S/O	S/O
TOR	(102)	0	(102)	365	(2 890)	(2 525)
UAG	1 934	(640)	1 294	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	62,92	63,86
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	24,62	28,59
Autres valeurs mobilières	0,01	0,33
Fonds d'investissement	10,08	9,85
Contrats de mise en pension	5,33	0,72
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,08)	(0,41)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,53)	(0,44)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,44	0,08
Titres vendus à découvert	S/O	(1,29)
Contrats de prise en pension	S/O	(0,04)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	1,74	1,72
Autriche	0,19	0,21
Belgique	0,12	0,12
Bermudes	0,57	0,66
Brésil	0,19	0,32
Canada	2,40	2,14
Îles Caïmans	2,42	3,29
Chili	0,02	0,06
Chine	0,16	0,27
Colombie	0,08	S/O
Chypre	0,09	0,09
République tchèque	0,05	S/O
Danemark	0,31	0,30
Finlande	0,21	0,20
France	2,54	2,51
Allemagne	1,56	1,98
Guernesey, Îles Anglo-normandes	0,34	0,33
Hong Kong	0,12	0,27
Inde	0,21	0,25
Indonésie	0,17	0,17
Irlande	0,69	0,78
Italie	1,82	2,62
Japon	2,00	1,59
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,49	0,53
Luxembourg	1,04	2,33
Île Maurice	0,09	0,37
Mexique	0,16	0,18
Multinationales	0,03	0,03

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Pays-Bas	2,86	2,56
Norvège	0,19	0,13
Panama	S/O	0,18
Pérou	0,09	1,25
Pologne	0,10	S/O
Qatar	0,10	0,10
Roumanie	0,35	0,31
Russie	0,00	0,02
Arabie saoudite	0,94	0,16
Singapour	0,39	0,17
Slovaquie	0,00	0,00
Slovénie	0,11	0,10
Afrique du Sud	0,75	0,95
Corée du Sud	0,07	0,07
Espagne	0,19	0,25
Supranationales	0,23	0,22
Suède	0,20	0,32
Suisse	1,83	2,23
Thaïlande	0,07	0,07
Turquie	0,04	0,04
Ukraine	S/O	0,02
Émirats arabes unis	0,08	0,08
Royaume-Uni	5,02	5,72
États-Unis	51,94	51,20
Îles Vierges britanniques	0,40	0,40
Instruments à court terme	1,79	2,91
Fonds d'investissement	10,08	9,85
Contrats de mise en pension	5,33	0,72
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,08)	(0,41)
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	S/O
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	(0,60)	(0,38)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	S/O	0,45
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,01)	(0,81)
Options sur titres	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,02	0,03
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,04	0,05
Contrats de change à terme	(0,30)	(0,50)
Contrats de change à terme couverts	0,69	0,86
Titres vendus à découvert	S/O	(1,29)
Autres actifs et passifs à court terme	(2,79)	(1,29)
Actifs nets	100,00	100,00

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
Électricité de France S.A.	€ 1 100	\$ 1 152	0,06	Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 750	\$ 414	0,02	INDIE			
4,625 % éch. 25/01/2043				0,625 % éch. 08/12/2050				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
5,500 % éch. 25/01/2035	£ 300	341	0,02	Deutsche Bank AG				Bharti Airtel Ltd.	\$ 1 200	\$ 1 167	0,06
6,250 % éch. 23/05/2033	\$ 1 000	1 017	0,06	1,447 % éch. 01/04/2025 (h)	\$ 2 000	1 901	0,11	4,375 % éch. 10/06/2025			
6,900 % éch. 23/05/2053	1 300	1 349	0,07	1,875 % éch. 23/02/2028	€ 2 500	2 417	0,13	Indian Railway Finance Corp. Ltd.	5 100	4 451	0,24
9,125 % éch. 15/03/2033 (f)	1 300	1 336	0,07	2,222 % éch. 18/09/2024	\$ 100	99	0,01	3,570 % éch. 21/01/2032			
Engie S.A.				2,311 % éch. 16/11/2027	3 000	2 580	0,14	JSW Hydro Energy Ltd.			
3,625 % éch. 11/01/2030	€ 1 000	1 081	0,06	2,552 % éch. 07/01/2028	1 600	1 389	0,08	4,125 % éch. 18/05/2031	3 612	3 051	0,17
4,000 % éch. 11/01/2035	2 000	2 177	0,12	3,125 % éch. 19/05/2033	€ 1 300	1 411	0,08	ReNew Power Pvt Ltd.	928	870	0,05
4,250 % éch. 11/01/2043	1 200	1 320	0,07	3,547 % éch. 18/09/2031	\$ 450	374	0,02	5,875 % éch. 05/03/2027			
Groupe des Assurances du Crédit Mutuel				3,742 % éch. 07/01/2033	1 300	954	0,05	ReNew Wind Energy AP2	3 000	2 559	0,14
1,850 % éch. 21/04/2042	600	481	0,03	3,961 % éch. 26/11/2025	500	477	0,03	4,500 % éch. 14/07/2028			
Holding d'Infrastructures de Transport SASU				E.ON SE				Total Inde		12 098	0,66
1,475 % éch. 18/01/2031	3 000	2 675	0,15	3,875 % éch. 12/01/2035	€ 1 000	1 085	0,06				
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement				Eurogrid GmbH				INDONÉSIE			
0,125 % éch. 16/09/2025	3 500	3 449	0,19	3,279 % éch. 05/09/2031	1 000	1 059	0,06	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
JCDecaux SE				Frappot AG Frankfurt Airport Services Worldwide				Bank Mandiri Persero Tbk PT	800	724	0,04
1,625 % éch. 07/02/2030	2 900	2 596	0,14	1,625 % éch. 09/07/2024	300	319	0,02	2,000 % éch. 19/04/2026			
L'Oréal S.A.				2,125 % éch. 09/07/2027	400	401	0,02				
0,875 % éch. 29/06/2026	2 300	2 329	0,13	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature)				IRLANDE			
New Immo Holding S.A.				3,750 % éch. 15/09/2026 (c)	300	306	0,02	TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
2,750 % éch. 26/11/2026	900	881	0,05	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				OCF Euro CLO DAC	2 000	2 179	0,12
SEB S.A.				0,000 % éch. 15/09/2028 (d)	7 450	6 950	0,38	4,713 % éch. 20/01/2033			
1,500 % éch. 31/05/2024	200	213	0,01	0,750 % éch. 30/09/2030	\$ 1 100	875	0,05	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Société Générale S.A.				1,375 % éch. 07/06/2032	€ 1 300	1 248	0,07	Abbott Ireland Financing DAC	1 600	1 656	0,09
0,500 % éch. 12/06/2029	400	355	0,02	2,750 % éch. 14/02/2033	750	806	0,04	0,100 % éch. 19/11/2024			
2,625 % éch. 22/01/2025	\$ 200	188	0,01	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	1 000	1 341	0,07	AIB Group PLC	2 800	2 773	0,15
3,625 % éch. 01/03/2041	1 050	683	0,04	1,000 % éch. 26/05/2042	1 700	1 341	0,07	2,250 % éch. 04/04/2028	2 700	2 895	0,16
4,000 % éch. 12/01/2027	2 200	2 053	0,11	Robert Bosch GmbH				4,625 % éch. 23/07/2029	2 000	2 250	0,12
6,096 % éch. 21/01/2026	1 500	1 486	0,08	4,375 % éch. 02/06/2043	1 000	1 120	0,06	5,750 % éch. 16/02/2029			
6,691 % éch. 10/01/2034	3 100	3 158	0,17	Vonovia SE				Bank of Ireland Group PLC	1 500	1 636	0,09
7,367 % éch. 10/01/2053	2 500	2 441	0,13	0,000 % éch. 01/12/2025 (d)	200	193	0,01	4,875 % éch. 16/07/2028	\$ 250	248	0,01
7,875 % éch. 18/12/2023 (f)(g)	200	196	0,01	0,250 % éch. 01/09/2028	1 900	1 614	0,09	6,253 % éch. 16/09/2026	£ 3 000	3 653	0,20
Suez SACA				1,375 % éch. 28/01/2026	2 600	2 591	0,14	7,594 % éch. 06/12/2032			
5,000 % éch. 03/11/2032	€ 1 200	1 391	0,08	1,625 % éch. 01/09/2051	100	53	0,00	CCEP Finance Ireland DAC	€ 1 900	1 712	0,10
Vilmorin & Cie S.A.				1,875 % éch. 28/06/2028	1 900	1 765	0,10	0,500 % éch. 06/09/2029			
1,375 % éch. 26/03/2028	1 200	1 028	0,06	2,375 % éch. 25/03/2032	400	356	0,02	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 933	927	0,05
		93 012	5,11	ZF Finance GmbH				2,875 % éch. 23/09/2023			
				2,000 % éch. 06/05/2027	500	476	0,03	Smurfit Kappa Acquisitions ULC	€ 300	316	0,02
				2,250 % éch. 03/05/2028	1 800	1 659	0,09	2,875 % éch. 15/01/2026			
ÉMISSIONS SOUVERAINES						38 831	2,14			18 066	0,99
Action Logement Services	2 500	2 327	0,13	ÉMISSIONS SOUVERAINES				Total Irlande		20 245	1,11
1,375 % éch. 13/04/2032	400	413	0,02	Land de Berlin				ISRAËL			
3,125 % éch. 28/09/2037	5 000	5 386	0,30	2,750 % éch. 14/02/2033	2 600	2 783	0,15	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
3,625 % éch. 25/05/2043				République d'Allemagne				Israel Discount Bank Ltd.	\$ 1 900	1 879	0,10
Agence Française de Développement				0,000 % éch. 15/08/2031 (d)	14 700	13 288	0,73	5,375 % éch. 26/01/2028			
1,625 % éch. 25/05/2032	2 000	1 912	0,11	4,750 % éch. 04/07/2028	2 000	2 407	0,13				
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale				État de Hesse				ITALIE			
1,375 % éch. 20/01/2031	\$ 4 000	3 256	0,18	2,875 % éch. 04/07/2033 (b)	1 200	1 297	0,07	TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
2,750 % éch. 25/11/2032	€ 1 000	1 060	0,06	État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie				Koromo Italy SRL	€ 1 989	2 175	0,12
3,000 % éch. 25/05/2028	1 200	1 298	0,07	0,500 % éch. 25/11/2039	200	144	0,01	4,213 % éch. 26/02/2035			
Obligation internationale du gouvernement français				2,900 % éch. 07/06/2033	1 975	2 138	0,12	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
0,500 % éch. 25/06/2044	2 100	1 358	0,07			22 057	1,21	Intesa Sanpaolo SpA	€ 1 000	832	0,05
2,000 % éch. 25/11/2032	950	961	0,05	Total Allemagne		60 888	3,35	2,625 % éch. 11/03/2036	€ 1 400	1 518	0,08
Région d'Île de France				GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				3,625 % éch. 30/06/2028	\$ 1 400	1 251	0,07
0,675 % éch. 24/11/2036	1 900	1 461	0,08	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,875 % éch. 12/01/2028	1 300	1 131	0,06
3,050 % éch. 03/02/2033	4 000	4 291	0,24	Globalworth Real Estate Investments Ltd.				4,000 % éch. 23/09/2029	900	672	0,04
3,700 % éch. 14/06/2038	3 900	4 335	0,24	2,950 % éch. 29/07/2026	1 850	1 522	0,08	4,198 % éch. 01/06/2032	2 100	1 385	0,08
SNCF Réseau				Sirius Real Estate Ltd.				4,950 % éch. 01/06/2042	4 600	4 457	0,25
0,750 % éch. 25/05/2036	500	394	0,02	1,125 % éch. 22/06/2026	1 100	992	0,06	5,017 % éch. 26/06/2024	€ 900	1 099	0,06
Société Du Grand Paris EPIC				1,750 % éch. 24/11/2028	2 300	1 792	0,10	6,625 % éch. 31/05/2033	\$ 800	798	0,04
3,500 % éch. 25/05/2043	2 200	2 338	0,13	Total Guernesey, Îles Anglo-normandes		4 306	0,24	7,778 % éch. 20/06/2033	400	399	0,02
3,700 % éch. 25/05/2053	2 000	2 193	0,12	HONG KONG				Mundys SpA	€ 2 900	2 705	0,15
Société Nationale SNCF S.A.				ÉMISSIONS SOUVERAINES				1,875 % éch. 12/02/2028			
3,125 % éch. 02/11/2027	5 600	6 024	0,33	Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong				Nexi SpA	1 600	1 459	0,08
3,375 % éch. 25/05/2033	4 100	4 480	0,25	2,375 % éch. 02/02/2051	\$ 300	204	0,01	2,125 % éch. 30/04/2029			
UNEDIC ASSEO				3,750 % éch. 07/06/2032	€ 3 500	3 846	0,21	Snam SpA	500	452	0,02
0,000 % éch. 19/11/2030 (d)	300	262	0,01	5,250 % éch. 11/01/2053	\$ 3 200	3 580	0,20	0,750 % éch. 20/06/2029			
0,250 % éch. 16/07/2035	1 000	774	0,04	Total Hong Kong		7 630	0,42				
Total France		137 535	7,56								
ALLEMAGNE											
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS											
Commerzbank AG											
3,125 % éch. 13/06/2033	2 400	2 598	0,14								

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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	\$ 1 900	\$ 1 675	0,09	LUXEMBOURG				CNH Industrial NV	\$ 1 650	\$ 1 647	0,09
1,982 % éch. 03/06/2027				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				4,500 % éch. 15/08/2023			
3,900 % éch. 31/07/2030	€ 2 500	2 698	0,15	Acef Holding S.C.A.	€ 1 700	\$ 1 519	0,08	Compass Group Finance Netherlands BV	€ 1 700	1 771	0,10
4,625 % éch. 12/04/2027	\$ 1 000	951	0,05	0,750 % éch. 14/06/2028	€ 2 650	2 216	0,12	3,000 % éch. 08/03/2030			
5,459 % éch. 30/06/2035	1 300	1 104	0,06	1,250 % éch. 26/04/2030				Cooperatieve Rabobank UA	\$ 3 500	3 128	0,17
7,296 % éch. 02/04/2034	3 400	3 206	0,18	CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan				1,004 % éch. 24/09/2026			
		27 792	1,53	European Core Fund	600	518	0,03	1,106 % éch. 24/02/2027	800	708	0,04
		29 967	1,65	0,500 % éch. 27/01/2028	3 700	2 956	0,16	3,649 % éch. 06/04/2028	3 400	3 151	0,17
				0,900 % éch. 12/10/2029				4,375 % éch. 29/06/2027 (f)(g)	€ 1 000	955	0,05
				CPI Property Group S.A.				4,875 % éch. 29/06/2029 (f)(g)	€ 2 800	2 572	0,14
				1,500 % éch. 27/01/2031	500	297	0,02	5,250 % éch. 14/09/2027	£ 1 200	1 418	0,08
				1,625 % éch. 23/04/2027	700	558	0,03	CTP NV			
				1,750 % éch. 14/01/2030	3 050	2 020	0,11	0,500 % éch. 21/06/2025	€ 3 800	3 696	0,20
				2,750 % éch. 12/05/2026	1 062	943	0,05	0,875 % éch. 20/01/2026	2 900	2 702	0,15
				2,750 % éch. 22/01/2028	€ 350	298	0,02	1,250 % éch. 21/06/2029	500	396	0,02
				Logicor Financing SARL				1,500 % éch. 27/09/2031	2 500	1 904	0,10
				1,625 % éch. 17/01/2030	€ 500	404	0,02	Digital Dutch Finco BV			
				2,000 % éch. 17/01/2034	2 900	2 105	0,12	1,000 % éch. 15/01/2026	350	270	0,01
				Segro Capital SARL				1,250 % éch. 01/02/2031	1 900	1 550	0,09
				1,875 % éch. 23/03/2030	950	871	0,05	Digital Intrepid Holding BV			
				SELP Finance SARL				0,625 % éch. 15/07/2031	1 600	1 215	0,07
				0,875 % éch. 27/05/2029	1 950	1 664	0,09	1,375 % éch. 18/07/2032	1 000	782	0,04
						16 369	0,90	Enel Finance International NV			
								1,875 % éch. 12/07/2028	\$ 1 700	1 427	0,08
				ÉMISSIONS SOUVERAINES				2,250 % éch. 12/07/2031	2 300	1 804	0,10
				État du Grand-Duché de Luxembourg				2,650 % éch. 10/09/2024	200	193	0,01
				0,000 % éch. 14/09/2032 (d)	2 000	1 668	0,09	2,875 % éch. 11/04/2029	£ 3 100	3 275	0,18
				Total Luxembourg		18 037	0,99	4,250 % éch. 15/06/2025	\$ 1 900	1 845	0,10
								7,750 % éch. 14/10/2052	2 000	2 346	0,13
				ÎLE MAURICE				Holcim Sterling Finance Netherlands BV			
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				2,250 % éch. 04/04/2034	£ 1 800	1 580	0,09
				India Green Energy Holdings	\$ 3 550	3 471	0,19	Iberdrola International BV			
				5,375 % éch. 29/04/2024				6,750 % éch. 15/09/2033	\$ 1 200	1 271	0,07
				India Green Power Holdings				ING Groep NV			
				4,000 % éch. 22/02/2027	1 200	1 050	0,06	1,250 % éch. 16/02/2027	€ 1 200	1 199	0,07
				Total Ile Maurice		4 521	0,25	1,400 % éch. 01/07/2026	€ 1 800	1 640	0,09
								1,726 % éch. 01/04/2027	1 900	1 694	0,09
				MEXIQUE				2,125 % éch. 23/05/2026	€ 2 700	2 810	0,15
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,875 % éch. 16/05/2027 (f)(g)	€ 200	143	0,01
				Banco Mercantil del Norte S.A.	1 800	1 393	0,08	4,125 % éch. 24/08/2033	€ 2 100	2 162	0,12
				6,625 % éch. 24/01/2032 (f)(g)				4,250 % éch. 16/05/2031 (f)(g)	\$ 1 000	668	0,04
				Metalsa S.A. de C.V.				6,500 % éch. 16/04/2025 (f)(g)	300	280	0,02
				3,750 % éch. 04/05/2031	2 900	2 286	0,12	JAB Holdings BV			
						3 679	0,20	4,500 % éch. 08/04/2052	4 100	3 171	0,17
								5,000 % éch. 12/06/2033	€ 200	222	0,01
				ÉMISSIONS SOUVERAINES				JDE Peet's NV			
				Obligation internationale du gouvernement mexicain				1,125 % éch. 16/06/2033	300	246	0,01
				6,338 % éch. 04/05/2053	2 000	2 042	0,11	2,250 % éch. 24/09/2031	\$ 1 000	775	0,04
				Total Mexique		5 721	0,31	LeasePlan Corp. NV			
								0,250 % éch. 07/09/2026	€ 3 500	3 361	0,18
				MULTINATIONALES				1,375 % éch. 07/03/2024	800	855	0,05
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Mondelez International Holdings Netherlands BV	2 000	1 778	0,10
				NXP BV				0,250 % éch. 09/09/2029			
				2,500 % éch. 11/05/2031	2 660	2 169	0,12	Nationale-Nederlanden Bank NV			
				3,875 % éch. 18/06/2026	150	144	0,01	0,500 % éch. 21/09/2028	3 200	2 894	0,16
				5,000 % éch. 15/01/2033	6 500	6 245	0,34	1,875 % éch. 17/05/2032	500	489	0,03
				Total Multinationales		8 558	0,47	3,250 % éch. 28/05/2027	2 000	2 163	0,12
								NE Property BV			
				PAYS-BAS				2,000 % éch. 20/01/2030	4 200	3 391	0,19
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,375 % éch. 14/07/2027	600	588	0,03
				ABB Finance BV	€ 800	859	0,05	NN Group NV			
				3,250 % éch. 16/01/2027				4,500 % éch. 15/01/2026 (f)	200	211	0,01
				ABN AMRO Bank NV	\$ 7 800	6 538	0,36	4,625 % éch. 13/01/2048	200	211	0,01
				2,470 % éch. 13/12/2029	€ 400	428	0,02	Prosus NV			
				4,000 % éch. 16/01/2028	\$ 1 500	1 448	0,08	2,085 % éch. 19/01/2030	1 300	1 112	0,06
				4,750 % éch. 28/07/2025	€ 2 000	2 462	0,14	2,778 % éch. 19/01/2034	200	161	0,01
				5,250 % éch. 26/05/2026				3,257 % éch. 19/01/2027	\$ 2 200	1 989	0,11
				Achmea Bank NV				Siemens Energy Finance BV			
				3,000 % éch. 31/01/2030	€ 2 100	2 245	0,12	4,000 % éch. 05/04/2026	€ 2 500	2 668	0,15
				Akzo Nobel NV				Sika Capital BV			
				2,000 % éch. 28/03/2032	750	698	0,04	3,750 % éch. 03/11/2026	2 000	2 169	0,12
				Arcadis NV				Stedin Holding NV			
				4,875 % éch. 28/02/2028	1 900	2 073	0,11	0,500 % éch. 14/11/2029	100	90	0,00
								Telefonica Europe BV			
								6,135 % éch. 03/02/2030 (f)	2 500	2 638	0,15
								Tennet Holding BV			
								4,250 % éch. 28/04/2032	1 000	1 145	0,06

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
Thermo Fisher Scientific Finance BV 1,625 % éch. 18/10/2041	€ 700	\$ 526	0,03	SINGAPOUR				Caja Rural de Navarra SCC 3,000 % éch. 26/04/2027	€ 1 700	\$ 1 806	0,10
Universal Music Group NV 4,000 % éch. 13/06/2031	600	653	0,04	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Celnex Finance Co. S.A. 3,875 % éch. 07/07/2041	\$ 1 000	734	0,04
Van Lanschoot Kempen NV 3,500 % éch. 31/05/2026	1 000	1 082	0,06	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. 4,250 % éch. 25/03/2027	\$ 1 209	\$ 1 062	0,06	Werfen S.A. 4,625 % éch. 06/06/2028	€ 2 200	2 370	0,13
Vesteda Finance BV 0,750 % éch. 18/10/2031	5 300	4 378	0,24	Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5,340 % éch. 19/05/2063	1 250	1 266	0,07			20 990	1,16
Vonovia Finance BV 0,500 % éch. 14/09/2029	100	82	0,00	SingTel Group Treasury Pte. Ltd. 3,875 % éch. 28/08/2028	900	863	0,05	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
1,125 % éch. 14/09/2034	200	142	0,01	United Overseas Bank Ltd. 3,863 % éch. 07/10/2032 (g)	4 000	3 750	0,20	Communauté autonome d'Andalousie 3,950 % éch. 30/04/2033	2 500	2 787	0,15
Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % éch. 03/12/2027	4 200	3 983	0,22	Total Singapour	6 941	6 941	0,38	Junta de Castilla y Leon 3,500 % éch. 30/04/2033 (b)	1 400	1 503	0,08
WFC Eurobond BV 1,350 % éch. 15/04/2028	300	278	0,02	CORÉE DU SUD				Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,000 % éch. 30/07/2042	3 170	2 181	0,12
		112 404	6,18	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Xunta de Galicia 0,084 % éch. 30/07/2027	150	143	0,01
TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				Hana Bank 3,750 % éch. 04/05/2026	€ 7 500	8 103	0,45			6 614	0,36
Green Storm BV 4,138 % éch. 22/02/2068	200	220	0,01	KB Kookmin Card Co. Ltd. 1,500 % éch. 13/05/2026	\$ 2 600	2 303	0,13	Total Espagne		27 604	1,52
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Kodit Global Co. Ltd. 4,954 % éch. 25/05/2026	3 700	3 643	0,20	SUPRANATIONALES			
BNG Bank NV 0,050 % éch. 20/11/2029	700	628	0,03	Kookmin Bank 2,500 % éch. 04/11/2030 (g)	900	731	0,04	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
0,500 % éch. 26/11/2025	500	508	0,03	Shinhan Bank Co. Ltd. 1,183 % éch. 29/09/2025	AUC 1 100	666	0,04	Banque de développement asiatique 1,500 % éch. 04/05/2028	CAC 2 000	1 347	0,07
3,000 % éch. 11/01/2033	5 000	5 403	0,30	4,000 % éch. 23/04/2029 (g)	\$ 1 100	1 003	0,05	6,550 % éch. 26/01/2025	ZAF 64 000	3 246	0,18
3,500 % éch. 19/05/2028	\$ 1 600	1 540	0,08	4,375 % éch. 13/04/2032 (g)	2 200	2 006	0,11	Banque Ouest Africaine de Développement 2,750 % éch. 22/01/2033	€ 800	637	0,03
Nederlandse Waterschapsbank NV 0,125 % éch. 03/09/2035	€ 2 000	1 517	0,08	5,862 % éch. 16/11/2025	AUC 1 500	1 018	0,06	Eurofima Europäische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0,000 % éch. 28/07/2026 (d)	1 000	978	0,05
2,750 % éch. 17/12/2029	500	532	0,03	Shinhan Financial Group Co. Ltd. 1,350 % éch. 10/01/2026	\$ 300	270	0,01	3,125 % éch. 09/11/2031	3 200	3 473	0,19
3,000 % éch. 20/04/2033	6 500	7 036	0,39	SK Broadband Co. Ltd. 3,875 % éch. 13/08/2023	500	499	0,03	Banque européenne pour la reconstruction et le développement 1,500 % éch. 13/02/2025	\$ 880	831	0,05
		17 164	0,94	SK Hynix, Inc. 1,000 % éch. 19/01/2024	600	583	0,03	1,625 % éch. 27/09/2024	500	477	0,03
Total Pays-Bas		129 788	7,13	2,375 % éch. 19/01/2031	1 000	772	0,04	Banque européenne d'investissement 0,750 % éch. 15/07/2027	AUC 2 100	1 205	0,07
NORVÈGE				6,375 % éch. 17/01/2028	4 400	4 420	0,24	1,500 % éch. 15/06/2032	€ 3 000	2 887	0,16
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS						26 017	1,43	Union européenne 0,000 % éch. 04/11/2025 (d)	1 400	1 414	0,08
DNB Bank ASA 0,375 % éch. 18/01/2028	2 400	2 302	0,13	ÉMISSIONS SOUVERAINES				0,000 % éch. 04/10/2030 (d)	3 700	3 258	0,18
PÉROU				Export-Import Bank of Korea 2,125 % éch. 18/01/2032	2 000	1 639	0,09	0,000 % éch. 04/07/2035 (d)	1 700	1 281	0,07
ÉMISSIONS SOUVERAINES				5,125 % éch. 11/01/2033	3 600	3 693	0,20	0,300 % éch. 04/11/2050	1 900	1 017	0,06
Obligation internationale du gouvernement péruvien 1,950 % éch. 17/11/2036	2 000	1 583	0,09	Korea Expressway Corp. 1,125 % éch. 17/05/2026	1 000	886	0,05	0,400 % éch. 04/02/2037	2 150	1 643	0,09
PHILIPPINES				Korea Housing Finance Corp. 0,010 % éch. 05/02/2025	€ 400	408	0,02	1,250 % éch. 04/02/2043	8 000	6 287	0,34
ÉMISSIONS SOUVERAINES				4,625 % éch. 24/02/2028	\$ 2 200	2 169	0,12	2,625 % éch. 04/02/2048	2 880	2 840	0,16
Obligation internationale du gouvernement philippin 5,500 % éch. 17/01/2048	\$ 3 900	4 007	0,22	Korea Water Resources Corp. 3,500 % éch. 27/04/2025	3 500	3 375	0,19	2,750 % éch. 04/02/2033	2 370	2 529	0,14
POLOGNE						12 170	0,67	2,750 % éch. 04/12/2037	10 000	10 391	0,57
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Total Corée du Sud		38 187	2,10	Banque internationale pour la reconstruction et le développement 0,125 % éch. 03/01/2051	1 600	780	0,04
Obligation internationale du gouvernement polonais 4,875 % éch. 04/10/2033	1 500	1 475	0,08	ESPAGNE				2,900 % éch. 19/01/2033	2 400	2 575	0,14
ROUMANIE				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,100 % éch. 14/04/2038	2 900	3 130	0,17
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,862 % éch. 14/09/2026	1 200	1 184	0,07	Total Supranationales		52 226	2,87
Obligation internationale du gouvernement roumain 1,375 % éch. 02/12/2029	€ 500	424	0,02	6,138 % éch. 14/09/2028	1 000	1 003	0,06	SUÈDE			
1,750 % éch. 13/07/2030	2 500	2 086	0,12	Banco de Sabadell S.A. 5,125 % éch. 10/11/2028	€ 1 500	1 651	0,09	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
2,625 % éch. 02/12/2040	3 400	2 265	0,12	Banco Santander S.A. 0,625 % éch. 24/06/2029	800	725	0,04	EQT AB 0,875 % éch. 14/05/2031	3 200	2 490	0,14
3,750 % éch. 07/02/2034	900	796	0,04	2,750 % éch. 12/09/2023	400	505	0,03	2,375 % éch. 06/04/2028	1 000	962	0,05
4,625 % éch. 03/04/2049	100	84	0,01	3,490 % éch. 28/05/2030	\$ 400	349	0,02	2,875 % éch. 06/04/2032	3 000	2 613	0,14
5,000 % éch. 27/09/2026	400	438	0,02	3,625 % éch. 21/03/2029 (f)(g)	€ 600	432	0,02	Sagax AB 1,125 % éch. 30/01/2027	800	737	0,04
Total Roumanie		6 093	0,33	4,125 % éch. 12/11/2027 (f)(g)	1 000	820	0,05	Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,000 % éch. 09/11/2026	1 500	1 618	0,09
SERBIE				4,175 % éch. 24/03/2028	\$ 2 000	1 874	0,10	Svenska Handelsbanken AB 0,125 % éch. 03/11/2026	300	289	0,02
ÉMISSIONS SOUVERAINES				4,375 % éch. 14/01/2026 (f)(g)	€ 400	367	0,02	Volvo Car AB 2,500 % éch. 07/10/2027	1 400	1 386	0,08
Obligation internationale du gouvernement serbe 1,000 % éch. 23/09/2028	1 500	1 270	0,07	Bankinter S.A. 0,625 % éch. 06/10/2027	1 000	932	0,05			10 095	0,56
1,650 % éch. 03/03/2033	400	291	0,02	CaixaBank S.A. 0,625 % éch. 21/01/2028	3 000	2 884	0,16	ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Total Serbie		1 561	0,09	0,750 % éch. 10/07/2026	600	609	0,03	Kommuninvest Sverige AB 3,375 % éch. 15/03/2027	700	765	0,04
				1,500 % éch. 03/12/2026	£ 700	769	0,04	Obligation internationale du gouvernement suédois 0,125 % éch. 09/09/2030	SEK 9 000	704	0,04
				4,625 % éch. 16/05/2027	€ 1 000	1 081	0,06			1 469	0,08
				5,375 % éch. 14/11/2030	100	112	0,01	Total Suède		11 564	0,64
				5,875 % éch. 09/10/2027 (f)(g)	800	783	0,04				

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
5,150 % éch. 02/03/2028	\$ 2 800	\$ 2 799	0,15	Cigna Group	\$ 163	\$ 163	0,01	Equifax, Inc.	\$ 1 200	\$ 1 183	0,06
5,250 % éch. 02/03/2030	4 400	4 412	0,24	3,750 % éch. 15/07/2023				5,100 % éch. 01/06/2028			
5,600 % éch. 02/03/2043	1 600	1 606	0,09	Citigroup, Inc.	1 400	1 129	0,06	Equinix, Inc.	1 600	1 304	0,07
5,650 % éch. 02/03/2053	50	51	0,00	2,520 % éch. 03/11/2032	8 100	6 762	0,37	2,500 % éch. 15/05/2031			
5,750 % éch. 02/03/2063	100	102	0,01	2,572 % éch. 03/06/2031 (h)	0	0	0,00	Equitable Financial Life Global Funding			
Apple, Inc.				4,658 % éch. 24/05/2028	2 000	1 992	0,11	0,600 % éch. 16/06/2028	€ 1 300	1 194	0,07
2,200 % éch. 11/09/2029	1 961	1 722	0,09	5,746 % éch. 25/01/2026 (h)	1 400	1 406	0,08	1,300 % éch. 12/07/2026	\$ 4 450	3 884	0,21
4,150 % éch. 10/05/2030	1 050	1 034	0,06	6,270 % éch. 17/11/2033 (h)	0	0	0,00	5,500 % éch. 02/12/2025	1 600	1 580	0,09
4,300 % éch. 10/05/2033	550	547	0,03	6,462 % éch. 24/05/2025				ERAC USA Finance LLC			
Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.				Citizens Bank N.A.	3 650	3 390	0,19	3,800 % éch. 01/11/2025	5 000	4 785	0,26
3,600 % éch. 15/09/2051	550	378	0,02	5,284 % éch. 26/01/2026				Essential Properties LP			
Astrazeneca Finance LLC				Clearway Energy Operating LLC	700	571	0,03	2,950 % éch. 15/07/2031	200	150	0,01
1,750 % éch. 28/05/2028	100	87	0,00	3,750 % éch. 15/01/2032				Eversource Energy			
4,900 % éch. 03/03/2030	1 300	1 303	0,07	Comcast Corp.	3 810	3 784	0,21	1,650 % éch. 15/08/2030	800	635	0,03
AT&T, Inc.				4,650 % éch. 15/02/2033	2 000	2 030	0,11	F&G Global Funding			
3,550 % éch. 15/09/2055	246	172	0,01	5,500 % éch. 15/05/2064				2,300 % éch. 11/04/2027	700	619	0,03
4,300 % éch. 15/02/2030	1 300	1 235	0,07	CommonSpirit Health	600	505	0,03	FactSet Research Systems, Inc.	4 100	3 492	0,19
4,850 % éch. 25/05/2047 (h)	CAD 1 500	1 015	0,06	2,782 % éch. 01/10/2030				3,450 % éch. 01/03/2032			
Autodesk, Inc.				Commonwealth Edison Co.	2 200	846	0,05	Farmers Exchange Capital	400	352	0,02
2,400 % éch. 15/12/2031	\$ 2 900	2 375	0,13	2,200 % éch. 01/03/2030	1 000	846	0,05	5,454 % éch. 15/10/2054			
Bank of America Corp.				Community Preservation Corp.	1 225	1 028	0,06	Fifth Third Bancorp	2 200	2 192	0,12
0,583 % éch. 24/08/2028	€ 200	187	0,01	2,867 % éch. 01/02/2030				6,361 % éch. 27/10/2028			
1,102 % éch. 24/05/2032	300	258	0,01	Continental Wind LLC	2 406	2 433	0,13	First American Financial Corp.	3 600	2 741	0,15
1,734 % éch. 23/07/2027	\$ 300	268	0,01	6,000 % éch. 28/02/2030				2,400 % éch. 15/08/2031	700	614	0,03
1,898 % éch. 23/07/2031	2 700	2 151	0,12	Corebridge Financial, Inc.	7 150	6 222	0,34	4,000 % éch. 15/05/2030			
2,087 % éch. 14/06/2029	2 400	2 049	0,11	3,900 % éch. 05/04/2032				Fiserv, Inc.			
2,299 % éch. 21/07/2032	600	480	0,03	Corporate Office Properties LP				3,000 % éch. 01/07/2031	£ 100	102	0,01
2,456 % éch. 22/10/2025	1 700	1 624	0,09	2,000 % éch. 15/01/2029	700	534	0,03	Ford Motor Credit Co. LLC	€ 900	951	0,05
2,687 % éch. 22/04/2032	6 600	5 472	0,30	2,250 % éch. 15/03/2026	500	443	0,02	1,744 % éch. 19/07/2024	€ 300	323	0,02
2,824 % éch. 27/04/2033	€ 700	681	0,04	2,750 % éch. 15/04/2031	400	304	0,02	3,021 % éch. 06/03/2024	200	216	0,01
2,884 % éch. 22/10/2030	\$ 1 100	948	0,05	Crown Castle, Inc.				4,174 % éch. 01/12/2024	€ 400	484	0,03
2,972 % éch. 04/02/2033	300	250	0,01	2,500 % éch. 15/07/2031	1 000	822	0,05	4,535 % éch. 06/03/2025	£ 400	484	0,03
3,384 % éch. 02/04/2026	7 800	7 481	0,42	3,250 % éch. 15/01/2051	600	410	0,02	FS KKR Capital Corp.			
3,458 % éch. 15/03/2025	1 100	1 078	0,06	5,000 % éch. 11/01/2028	2 600	2 554	0,14	3,125 % éch. 12/10/2028	\$ 1 300	1 060	0,06
3,559 % éch. 23/04/2027	2 600	2 466	0,14	5,200 % éch. 15/02/2049	100	93	0,01	Gap, Inc.			
4,412 % éch. 24/08/2025	€ 1 400	1 533	0,08	CVS Health Corp.				3,625 % éch. 01/10/2029	2 550	1 805	0,10
5,015 % éch. 22/07/2033	\$ 4 900	4 796	0,26	4,300 % éch. 25/03/2028	192	185	0,01	Gilead Sciences, Inc.			
6,204 % éch. 10/11/2028	4 060	4 176	0,23	5,125 % éch. 21/02/2030	3 800	3 776	0,21	2,500 % éch. 01/09/2023	875	870	0,05
Bank of New York Mellon Corp.				CVS Pass-Through Trust				Goldman Sachs Group, Inc.			
4,543 % éch. 01/02/2029	4 300	4 189	0,23	4,163 % éch. 11/08/2036	113	97	0,01	1,000 % éch. 16/12/2025	€ 200	235	0,01
4,706 % éch. 01/02/2034	2 800	2 691	0,15	Dell International LLC	1 470	1 038	0,06	1,000 % éch. 18/03/2033	€ 600	488	0,03
5,802 % éch. 25/10/2028	3 500	3 570	0,20	3,375 % éch. 15/12/2041	1 200	1 220	0,07	1,500 % éch. 07/12/2027	£ 800	823	0,05
Baxter International, Inc.				6,020 % éch. 15/06/2026	25	31	0,00	1,542 % éch. 10/09/2027	\$ 400	352	0,02
5,351 % éch. 01/12/2023	350	349	0,02	8,350 % éch. 15/07/2046				1,875 % éch. 16/12/2030	£ 1 100	1 038	0,06
Blackstone Holdings Finance Co. LLC				Digital Euro Finco LLC	€ 950	966	0,05	1,992 % éch. 27/01/2032	\$ 1 000	788	0,04
2,850 % éch. 05/08/2051	600	345	0,02	2,500 % éch. 16/01/2026				2,383 % éch. 21/07/2032	900	721	0,04
6,200 % éch. 22/04/2033	400	409	0,02	Digital Realty Trust LP	\$ 1 500	1 334	0,07	2,615 % éch. 22/04/2032	7 400	6 071	0,33
Blue Owl Finance LLC				Digital Stout Holding LLC				2,640 % éch. 24/02/2028	3 300	2 997	0,16
3,125 % éch. 10/06/2031	200	152	0,01	3,300 % éch. 19/07/2029	£ 100	103	0,01	2,650 % éch. 21/10/2032	900	734	0,04
BlueHub Loan Fund, Inc.				3,750 % éch. 17/10/2030	400	415	0,02	3,102 % éch. 24/02/2033	1 100	930	0,05
3,099 % éch. 01/01/2030	650	533	0,03	Discover Bank	\$ 3 860	3 555	0,20	3,125 % éch. 25/07/2029	£ 400	425	0,02
Booking Holdings, Inc.				3,450 % éch. 27/07/2026				3,691 % éch. 05/06/2028	\$ 500	470	0,03
0,100 % éch. 08/03/2025	€ 500	511	0,03	4,200 % éch. 08/08/2023	2 000	1 996	0,11	3,750 % éch. 30/04/2024	€ 300	327	0,02
4,125 % éch. 12/05/2033	600	625	0,04	Discovery Communications LLC				5,236 % éch. 02/05/2024	AUD 2 000	1 334	0,07
Boston Properties LP				4,875 % éch. 01/04/2043	1 900	1 548	0,08	Goodman U.S. Finance Five LLC	\$ 4 100	3 773	0,21
2,550 % éch. 01/04/2032	\$ 930	702	0,04	Doris Duke Charitable Foundation				4,625 % éch. 04/05/2032			
6,500 % éch. 15/01/2034	2 800	2 820	0,15	2,345 % éch. 01/07/2050	400	244	0,01	4,047 % éch. 17/05/2028	500	468	0,03
Brandywine Operating Partnership LP				DTE Electric Co.	1 500	1 314	0,07	Haleon U.S. Capital LLC	2 550	2 319	0,13
3,950 % éch. 15/11/2027	500	397	0,02	1,900 % éch. 01/04/2028	1 100	797	0,04	Hanover Insurance Group, Inc.	300	237	0,01
Bush Foundation				3,250 % éch. 01/04/2051	700	577	0,03	2,500 % éch. 01/09/2030			
2,754 % éch. 01/10/2050	375	252	0,01	3,950 % éch. 01/03/2049				HAT Holdings LLC			
Capital One Financial Corp.				Duke Energy Florida LLC	300	259	0,01	3,375 % éch. 15/06/2026	255	229	0,01
5,468 % éch. 01/02/2029	100	96	0,01	2,500 % éch. 01/12/2029	1 300	1 193	0,07	3,750 % éch. 15/09/2030	3 200	2 514	0,14
6,377 % éch. 08/06/2034	2 200	2 185	0,12	Duke Energy Progress LLC				HCA, Inc.			
CBRE Services, Inc.				3,450 % éch. 15/03/2029				4,125 % éch. 15/06/2029	4 700	4 352	0,24
2,500 % éch. 01/04/2031	1 000	805	0,04	Elevance Health, Inc.	1 812	1 598	0,09	4,500 % éch. 15/02/2027	1 700	1 641	0,09
Centene Corp.				2,875 % éch. 15/09/2029				5,000 % éch. 15/03/2024	2 000	1 988	0,11
2,625 % éch. 01/08/2031	600	479	0,03	Eli Lilly & Co.				Healthpeak OP LLC			
3,000 % éch. 15/10/2030	8 700	7 258	0,40	1,375 % éch. 14/09/2061	€ 700	405	0,02	2,125 % éch. 01/12/2028	1 750	1 477	0,08
CenterPoint Energy Houston Electric LLC				Empower Finance LP	\$ 0	0	0,00	Host Hotels & Resorts LP			
5,300 % éch. 01/04/2053	5 250	5 375	0,30	1,776 % éch. 17/03/2031				2,900 % éch. 15/12/2031	2 200	1 733	0,10
Charles Schwab Corp.				Enel Finance America LLC	1 250	1 314	0,07	3,375 % éch. 15/12/2029	5 800	4 962	0,27
2,000 % éch. 20/03/2028	300	259	0,01	7,100 % éch. 14/10/2027				3,875 % éch. 01/04/2024	100	98	0,01
4,000 % éch. 01/12/2030 (f)	1 400	1 028	0,06	Energy Louisiana LLC	1 700	1 563	0,09	4,000 % éch. 15/06/2025	500	481	0,03
5,643 % éch. 19/05/2029	600	600	0,03	4,750 % éch. 15/09/2052				4,500 % éch. 01/02/2026	100	97	0,01
5,853 % éch. 19/05/2034	600	609	0,03								
Church & Dwight Co., Inc.											
5,600 % éch. 15/11/2032	1 200	1 269	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
Hudson Pacific Properties LP 5,950 % éch. 15/02/2028	\$ 3 600	\$ 2 865	0,16	MSCI, Inc. 3,250 % éch. 15/08/2033 4,000 % éch. 15/11/2029	\$ 800 100	\$ 645 91	0,04 0,01	Rayonier LP 2,750 % éch. 17/05/2031	\$ 1 500	\$ 1 208	0,07
Humana, Inc. 1,350 % éch. 03/02/2027 3,700 % éch. 23/03/2029 3,950 % éch. 15/03/2027 5,875 % éch. 01/03/2033	1 250 3 200 95 3 000	1 088 2 933 91 3 119	0,06 0,16 0,01 0,17	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 4,150 % éch. 15/12/2032	2 550	2 367	0,13	Realty Income Corp. 1,750 % éch. 13/07/2033 4,700 % éch. 15/12/2028	£ 2 000 \$ 1 000	1 701 970	0,09 0,05
International Flavors & Fragrances, Inc. 1,832 % éch. 15/10/2027	1 600	1 351	0,07	Netflix, Inc. 3,625 % éch. 15/06/2030 3,875 % éch. 15/11/2029	€ 1 500 3 400	1 560 3 622	0,09 0,20	Regency Centers LP 2,950 % éch. 15/09/2029	1 100	945	0,05
Interstate Power & Light Co. 3,600 % éch. 01/04/2029	1 200	1 097	0,06	Neuberger Berman Group LLC 4,875 % éch. 15/04/2045	\$ 200	164	0,01	Reinsurance Group of America, Inc. 6,000 % éch. 15/09/2033	1 500	1 511	0,08
IQVIA, Inc. 5,700 % éch. 15/05/2028	3 000	2 974	0,16	New York State Electric & Gas Corp. 2,150 % éch. 01/10/2031	400	313	0,02	Reliance Steel & Aluminum Co. 2,150 % éch. 15/08/2030	1 000	816	0,04
John Deere Capital Corp. 3,350 % éch. 18/04/2029	1 900	1 769	0,10	Niagara Mohawk Power Corp. 1,960 % éch. 27/06/2030 5,783 % éch. 16/09/2052	3 000 2 690	2 402 2 701	0,13 0,15	RELX Capital, Inc. 4,000 % éch. 18/03/2029	700	668	0,04
JPMorgan Chase & Co. 1,045 % éch. 19/11/2026 2,545 % éch. 08/11/2032 2,580 % éch. 22/04/2032 2,739 % éch. 15/10/2030 4,203 % éch. 23/07/2029 4,323 % éch. 26/04/2028 4,565 % éch. 14/06/2030 4,912 % éch. 25/07/2033 6,163 % éch. 23/07/2024	1 500 8 750 7 400 1 800 1 500 4 500 300 5 600 1 100	1 344 7 173 6 149 1 552 1 427 4 346 289 5 474 1 101	0,07 0,39 0,34 0,09 0,08 0,24 0,02 0,30 0,06	Northern States Power Co. 2,600 % éch. 01/06/2051 2,900 % éch. 01/03/2050	1 300 1 700	835 1 173	0,05 0,06	RGA Global Funding 2,700 % éch. 18/01/2029	1 000	863	0,05
Kaiser Foundation Hospitals 2,810 % éch. 01/06/2041	2 850	2 096	0,12	NSTAR Electric Co. 4,950 % éch. 15/09/2052	1 300	1 264	0,07	S&P Global, Inc. 2,700 % éch. 01/03/2029	5 500	4 954	0,27
Kellogg Co. 2,650 % éch. 01/12/2023	734	727	0,04	Nuveen LLC 4,000 % éch. 01/11/2028	300	283	0,02	Salesforce, Inc. 1,500 % éch. 15/07/2028	1 750	1 509	0,08
Kilroy Realty LP 2,650 % éch. 15/11/2033 3,050 % éch. 15/02/2030	6 400 400	4 344 313	0,24 0,02	NVR, Inc. 3,000 % éch. 15/05/2030	2 000	1 734	0,10	San Diego Gas & Electric Co. 2,950 % éch. 15/08/2051	1 750	1 187	0,07
Lazard Group LLC 4,375 % éch. 11/03/2029	200	186	0,01	Oracle Corp. 3,950 % éch. 25/03/2051 (h)	300	227	0,01	Santander Holdings USA, Inc. 2,490 % éch. 06/01/2028	1 400	1 210	0,07
Lennox International, Inc. 3,000 % éch. 15/11/2023	1 480	1 463	0,08	Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % éch. 01/04/2053	3 200	3 145	0,17	SBA Tower Trust 1,631 % éch. 15/05/2051	1 000	864	0,05
Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % éch. 23/05/2059	€ 200	208	0,01	Pacific Life Global Funding 1,375 % éch. 14/04/2026	605	541	0,03	SCE Recovery Funding LLC 4,697 % éch. 15/06/2042	2 000	1 950	0,11
Liberty Utilities Finance GP 2,050 % éch. 15/09/2030	\$ 1 800	1 400	0,08	Pacific LifeCorp. 3,350 % éch. 15/09/2050	200	139	0,01	ServiceNow, Inc. 1,400 % éch. 01/09/2030	3 200	2 536	0,14
Low Income Investment Fund 3,711 % éch. 01/07/2029	300	269	0,01	PacifiCorp 5,350 % éch. 01/12/2053 5,500 % éch. 15/05/2054	1 200 4 700	1 098 4 416	0,06 0,24	SLM Corp. 3,125 % éch. 02/11/2026	1 400	1 212	0,07
Marriott International, Inc. 4,900 % éch. 15/04/2029	1 300	1 265	0,07	Penn Mutual Life Insurance Co. 3,800 % éch. 29/04/2061	1 800	1 221	0,07	Solar Star Funding LLC 5,375 % éch. 30/06/2035	1 866	1 840	0,10
McLaren Health Care Corp. 4,386 % éch. 15/05/2048	200	177	0,01	Physicians Realty LP 3,950 % éch. 15/01/2028	800	731	0,04	Southern California Edison Co. 2,500 % éch. 01/06/2031 3,600 % éch. 01/02/2045 3,650 % éch. 01/06/2051 3,900 % éch. 01/12/2041 4,500 % éch. 01/09/2040 4,875 % éch. 01/03/2049 5,950 % éch. 01/11/2032	200 1 600 2 500 100 190 200 3 750	166 1 179 1 859 78 166 180 3 928	0,01 0,06 0,10 0,00 0,01 0,01 0,22
Mercedes-Benz Finance North America LLC 4,950 % éch. 30/03/2025	2 500	2 482	0,14	PNC Bank N.A. 2,700 % éch. 22/10/2029	600	502	0,03	Southwestern Public Service Co. 5,150 % éch. 01/06/2052	2 000	1 862	0,10
Merck & Co., Inc. 1,900 % éch. 10/12/2028 4,900 % éch. 17/05/2044	2 000 1 950	1 748 1 956	0,10 0,11	PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % éch. 26/01/2027	5 880	5 750	0,32	Spirit Realty LP 4,450 % éch. 15/09/2026	100	94	0,01
Metropolitan Life Global Funding 0,375 % éch. 09/04/2024	€ 300	319	0,02	Principal Life Global Funding 1,250 % éch. 16/08/2026 1,375 % éch. 10/01/2025	2 750 2 000	2 400 1 866	0,13 0,10	Sprint LLC 7,875 % éch. 15/09/2023	100	100	0,01
Micron Technology, Inc. 2,703 % éch. 15/04/2032	\$ 1 800	1 421	0,08	Prologis Euro Finance LLC 1,500 % éch. 08/02/2034	€ 3 250	2 645	0,15	Standard Industries, Inc. 2,250 % éch. 21/11/2026	€ 1 600	1 555	0,09
MidAmerican Energy Co. 2,700 % éch. 01/08/2052 3,150 % éch. 15/04/2050 3,650 % éch. 01/08/2048 3,950 % éch. 01/08/2047	1 250 1 150 4 629 1 060	792 807 3 571 865	0,04 0,04 0,20 0,05	Prologis LP 2,250 % éch. 15/01/2032	\$ 600	485	0,03	State Street Corp. 3,700 % éch. 20/11/2023 5,751 % éch. 04/11/2026	\$ 2 000 2 600	1 982 2 615	0,11 0,14
Moody's Corp. 2,000 % éch. 19/08/2031 2,550 % éch. 18/08/2060 3,100 % éch. 29/11/2061 3,250 % éch. 15/01/2028	700 500 400 300	565 277 264 280	0,03 0,02 0,01 0,02	Protective Life Global Funding 1,618 % éch. 15/04/2026 1,737 % éch. 21/09/2030 1,900 % éch. 06/07/2028 6,140 % éch. 11/12/2024	800 800 300 5 000	717 628 256 5 015	0,04 0,03 0,01 0,28	Synchrony Financial 2,875 % éch. 28/10/2031 4,375 % éch. 19/03/2024 7,250 % éch. 02/02/2033	500 650 700	364 637 631	0,02 0,03 0,03
Morgan Stanley 1,102 % éch. 29/04/2033 1,375 % éch. 27/10/2026 1,928 % éch. 28/04/2032 5,050 % éch. 28/01/2027 5,123 % éch. 01/02/2029 6,342 % éch. 18/10/2033	€ 600 1 350 \$ 8 900 1 000 8 100 6 000	497 1 349 6 952 992 7 993 6 386	0,03 0,07 0,38 0,05 0,44 0,35	Public Service Co. of Colorado 2,700 % éch. 15/01/2051 3,200 % éch. 01/03/2050 3,700 % éch. 15/06/2028	625 2 827 2 100	396 2 000 1 995	0,02 0,11 0,11	T-Mobile USA, Inc. 2,400 % éch. 15/03/2029 2,550 % éch. 15/02/2031 2,625 % éch. 15/02/2029 3,300 % éch. 15/02/2051 3,600 % éch. 15/11/2060 3,875 % éch. 15/04/2030	450 2 000 1 000 900 300 700	387 1 663 869 632 211 645	0,02 0,09 0,05 0,03 0,01 0,04
Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc. 4,500 % éch. 20/06/2028	1 500	1 446	0,08	Public Service Co. of Oklahoma 3,150 % éch. 15/08/2051	2 600	1 728	0,09	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4,270 % éch. 15/05/2047	400	331	0,02
MPT Operating Partnership LP 2,550 % éch. 05/12/2023	£ 200	246	0,01	Public Service Electric & Gas Co. 3,100 % éch. 15/03/2032 4,650 % éch. 15/03/2033	2 950 4 700	2 581 4 616	0,14 0,25	Topaz Solar Farms LLC 5,750 % éch. 30/09/2039	1 324	1 300	0,07
				Puget Sound Energy, Inc. 5,448 % éch. 01/06/2053	4 050	4 083	0,22	Toyota Motor Credit Corp. 3,050 % éch. 22/03/2027 5,810 % éch. 11/12/2023	1 300 3 900	1 218 3 905	0,07 0,21
				Qorvo, Inc. 1,750 % éch. 15/12/2024	4 900	4 561	0,25	Travel + Leisure Co. 5,650 % éch. 01/04/2024	300	297	0,02
				Quanta Services, Inc. 2,900 % éch. 01/10/2030	5 500	4 677	0,26	Truist Financial Corp. 1,267 % éch. 02/03/2027 4,873 % éch. 26/01/2029 5,122 % éch. 26/01/2034	1 900 5 250 2 750	1 677 5 050 2 607	0,09 0,28 0,14

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
U.S. Bancorp	\$ 1 800	\$ 1 800	0,10	Xylem, Inc.	\$ 1 080	\$ 897	0,05	1,875 % éch. 15/02/2041	\$ 18 150	\$ 13 195	0,73
5,727 % éch. 21/10/2026				2,250 % éch. 30/01/2031				2,000 % éch. 15/11/2041 (i)	39 500	28 941	1,59
5,836 % éch. 12/06/2034	600	605	0,03	Zoetis, Inc.				2,250 % éch. 15/05/2041 (i)	28 900	22 281	1,23
UDR, Inc.	1 800	1 435	0,08	2,000 % éch. 15/05/2030	0	0	0,00	2,375 % éch. 15/02/2042 (i)	58 900	45 885	2,52
3,100 % éch. 01/11/2034								2,875 % éch. 15/05/2052	2 620	2 172	0,12
UnitedHealth Group, Inc.	1 400	1 456	0,08	CRÉDITS CONSORTIAUX ET CÉSSIONS				3,000 % éch. 15/02/2048	462	390	0,02
5,350 % éch. 15/02/2033	600	667	0,04	Hilton Domestic Operating Co., Inc.	1 200	1 201	0,07	3,125 % éch. 15/08/2044	432	374	0,02
5,875 % éch. 15/02/2053				6,939 % éch. 22/06/2026				3,125 % éch. 15/05/2048	42	36	0,00
USAA Capital Corp.	1 000	833	0,05	IQVIA, Inc.	1 000	1 091	0,06	3,250 % éch. 15/05/2042 (i)	38 800	34 643	1,90
2,125 % éch. 01/05/2030	1 300	1 249	0,07	5,598 % éch. 07/03/2024	€ 1 000			3,375 % éch. 15/08/2042	13 000	11 806	0,65
3,375 % éch. 01/05/2025								3,875 % éch. 15/05/2043 (j)	7 100	6 929	0,38
VeriSign, Inc.	1 100	916	0,05					4,000 % éch. 15/11/2042 (i)	27 600	27 436	1,51
2,700 % éch. 15/06/2031								Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)			
Verizon Communications, Inc.	€ 800	717	0,04	OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				0,625 % éch. 15/07/2032 (i)	31 422	28 898	1,59
0,375 % éch. 22/03/2029	\$ 5 560	4 397	0,24	Obligations California Health Facilities Financing Authority Revenue				BILLETS DE TRESORERIE			
1,500 % éch. 18/09/2030	700	615	0,03	Bonds, Series 2022				Billets du Trésor américain			
2,100 % éch. 22/03/2028	600	483	0,03	4,190 % éch. 01/06/2037			\$ 2 100	1 965	0,11	0,500 % éch. 30/11/2023 (i)	
2,355 % éch. 15/03/2032	1 550	1 104	0,06	Obligations University of Michigan Revenue Bonds, Series 2022			1 300	1 051	0,05	0,750 % éch. 30/04/2026	
2,850 % éch. 03/09/2041	500	386	0,02	3,504 % éch. 01/04/2052			1 300	1 051	0,05	3,125 % éch. 31/08/2027	
3,400 % éch. 22/03/2041	261	190	0,01	Obligations University of Pittsburgh of the Commonwealth System of Higher Education, Pennsylvania Revenue Bonds, Series 2017				4,250 % éch. 31/05/2025 (i)(j)		3 250	
3,700 % éch. 22/03/2061	2 400	2 252	0,12	3,646 % éch. 15/09/2036			2 000	1 819	0,10	4,250 % éch. 15/10/2025	
3,875 % éch. 08/02/2029	600	579	0,03					4,625 % éch. 15/03/2026		13 700	
4,329 % éch. 21/09/2028	2 000	1 979	0,11					STRIPS du Trésor américain		310	
5,050 % éch. 09/05/2033								0,000 % éch. 15/05/2046 (d)		2 200	
VF Corp.	3 500	2 878	0,16	AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				303 134		16,66	
2,950 % éch. 23/04/2030	0	0	0,00	Freddie Mac				Total États-Unis		1 116 784	
VMware, Inc.	3 000	2 865	0,16	0,375 % éch. 23/09/2025			1 700	1 543	0,08	ÎLES VIERGES BRITANNIQUES	
2,200 % éch. 15/08/2031				1,147 % éch. 25/08/2029 (a)			2 322	109	0,01	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS	
4,700 % éch. 15/05/2030	4 100	3 638	0,20	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			6 588	5 809	0,32	TSMC Global Ltd.	
Warnermedia Holdings, Inc.	500	408	0,02	3,500 % éch. 01/12/2052			99	90	0,01	1,250 % éch. 23/04/2026	
5,391 % éch. 15/03/2062				4,000 % éch. 01/12/2052 - 01/06/2053			14 160	13 298	0,73	INSTRUMENTS À COURT TERME	
Wells Fargo & Co.	3 100	3 030	0,17	4,500 % éch. 01/07/2052 - 01/06/2053			26 506	25 500	1,40	BILLETS DE TRESORERIE	
4,540 % éch. 15/08/2026	3 000	2 769	0,15	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			48 670	45 717	2,51	AT+T, Inc.	
Weyerhaeuser Co.	70	76	0,00	5,000 % éch. 01/08/2053			19 900	19 504	1,07	5,700 % éch. 19/03/2024	
4,000 % éch. 15/11/2029	1 850	1 813	0,10	6,000 % éch. 01/07/2053			111 500	112 493	6,18	Haleon UK Capital PLC	
6,875 % éch. 15/03/2032										5,520 % éch. 24/07/2023	
Wisconsin Electric Power Co.	6 760	6 692	0,37							Humana, Inc.	
4,750 % éch. 30/09/2032										5,450 % éch. 13/07/2023	
Wisconsin Power & Light Co.	2 250	1 487	0,08	OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN						Walgreens Boots Alliance	
4,950 % éch. 01/04/2033				Obligations du Trésor américain						6,000 % éch. 05/07/2023	
Wisconsin Public Service Corp.	1 200	941	0,05	1,625 % éch. 15/11/2050			4 770	2 965	0,16	Total des Instruments à court terme	
2,850 % éch. 01/12/2051										6 478	
WP Carey, Inc.										0,35	
2,450 % éch. 01/02/2032										Total des Valeurs mobilières	
										\$ 2 107 775	
										115,86	

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 2 319	Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	\$ (2 365)	\$ 2 319	\$ 2 319	0,13	
Total des Contrats de mise en pension							\$ (2 365)	\$ 2 319	\$ 2 319	0,13

(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 septembre	Long	09/2023	134	\$ (57)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans septembre	Long	09/2023	82	(111)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	335	393	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	599	657	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	201	(527)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	514	465	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	23	(86)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	394	(1 008)	(0,06)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	112	175	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	562	1 122	0,06

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 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	1 206	\$ 1 169	0,06
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	349	37	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	283	(544)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	164	187	0,01
				\$ 1 872	0,10
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ 1 872	0,10

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
Koninklijke KPN NV	(1,000) %	20/12/2023	€ 200	\$ (5)	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
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20/12/2027	\$ 1 100	\$ 25	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20/12/2026	900	(8)	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20/12/2027	1 000	17	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2023	2 100	(21)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	2 500	(22)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	700	5	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2025	€ 100	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2027	300	4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/06/2028	1 600	4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2028	400	2	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	\$ 600	8	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	300	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2024	800	20	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20/12/2026	3 000	(4)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20/06/2028	1 700	30	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20/06/2028	€ 1 000	4	0,00
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	600	(2)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2026	\$ 700	(11)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2026	2 200	(37)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	700	11	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2028	8 400	42	0,01
				\$ 74	0,01

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

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 ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250 %	20/09/2053	£ 800	\$ 72	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	\$ 40 600	(522)	(0,03)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,785	12/08/2051	800	254	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	13,026	02/01/2025	BRL 243 200	1 188	0,06
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,000	16/06/2026	CAD 13 800	(865)	(0,05)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,220	03/03/2025	600	(35)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,235	04/03/2025	1 100	(65)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,275	03/03/2025	600	(34)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,276	03/03/2025	300	(17)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,290	03/03/2025	200	(11)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	500	(37)	0,00
À payer	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	4,000	21/06/2025	70 100	(428)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,785	12/08/2023	\$ 800	4	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,600	15/12/2050	€ 2 300	1 192	0,07
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	10 100	39	0,00
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	81 400	192	0,01
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	44 600	154	0,01
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	10 500	5	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,475	16/06/2031	\$ 2 600	221	0,01
					\$ 1 307	0,07
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 1 376	0,08

⁽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.

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

- (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.

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	\$ 15	\$ 26	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	08/2023	AUD	\$ 5 653	\$ 3 822	\$ 55	\$ 55	0,00	
	08/2023	£	568	706	0	(16)	0,00	
	08/2023	SEK	1 428	139	6	0	6	0,00
BPS	07/2023	€	458 971	493 426	2	(7 314)	(0,40)	
	07/2023	\$	526 823	€ 480 789	0	(2 281)	(0,12)	
	08/2023	€	476 359	\$ 522 680	2 260	0	2 260	0,12
BRC	08/2023	ZAR	14 459	777	15	0	15	0,00
	08/2023	£	11 013	13 817	0	(187)	(187)	(0,01)
	08/2023	\$	6 010	¥ 823 780	0	(274)	(274)	(0,01)
CBK	08/2023	ZAR	17 495	\$ 947	24	0	24	0,00
	07/2023	€	6 064	6 507	0	(109)	(109)	(0,01)
	07/2023	\$	8 423	€ 7 713	10	(18)	(8)	0,00
CLY	08/2023	CAD	20 450	\$ 15 327	0	(137)	(137)	(0,01)
	08/2023	£	6 165	7 688	0	(152)	(152)	(0,01)
	08/2023	SEK	10 611	1 046	62	0	62	0,00
GLM	08/2023	\$	1 672	NOK 17 442	0	(42)	(42)	0,00
	08/2023	1 888	19 785	0	(38)	(38)	0,00	
	08/2023	735	7 800	0	(6)	(6)	0,00	
JPM	08/2023	£	36 672	\$ 46 447	0	(187)	(187)	(0,01)
	08/2023	\$	188	¥ 25 010	0	(14)	(14)	0,00
	08/2023	271	NOK 2 876	0	(2)	(2)	0,00	
MBC	07/2023	€	25 133	\$ 26 955	0	(465)	(465)	(0,03)
	07/2023	\$	1 021	€ 931	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023	CAD	398	\$ 300	0	(1)	(1)	0,00
MYI	08/2023	£	2 022	2 538	0	(34)	(34)	0,00
	07/2023	€	91	99	0	0	0	0,00
	07/2023	£	42	54	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	SEK	7 838	723	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$	85	€ 78	0	0	0	0,00
	07/2023	1 309	£ 1 037	9	0	9	0,00	
UAG	08/2023	2 461	¥ 327 013	0	(184)	(184)	(0,01)	
	07/2023	954	€ 870	0	(4)	(4)	0,00	
	08/2023	AUD	229	\$ 153	0	0	0	0,00
UAG	08/2023	£	554	687	0	(18)	(18)	0,00
	08/2023	\$	1 421	£ 1 122	6	0	6	0,00
	08/2023	£	32 122	\$ 40 601	0	(247)	(247)	(0,01)
	10/2023	ZAR	30 642	1 655	50	0	50	0,00
					\$ 2 499	\$ (11 737)	\$ (9 238)	(0,51)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	CHF	15	\$ 17	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07/2023	65 476	73 211	25	0	25	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
	07/2023	\$ 97 835	CHF 88 514	\$ 1 102	\$ 0	\$ 1 102	0,06
	08/2023	73 204	65 284	0	(25)	(25)	0,00
CLY	07/2023	CHF 34 604	\$ 38 523	0	(155)	(155)	(0,01)
	08/2023	\$ 38 523	CHF 34 505	155	0	155	0,01
JPM	07/2023	225	203	2	0	2	0,00
MBC	07/2023	CHF 56	\$ 62	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 316	CHF 283	1	0	1	0,00
MYI	07/2023	CHF 3 385	\$ 3 739	0	(44)	(44)	0,00
	07/2023	\$ 905	CHF 821	12	0	12	0,00
RYL	07/2023	CHF 4	\$ 4	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	\$ 69 771	CHF 62 694	305	0	305	0,02
UAG	07/2023	CHF 67 696	\$ 75 519	0	(149)	(149)	(0,01)
	07/2023	\$ 63 933	CHF 57 441	272	0	272	0,01
	08/2023	75 472	67 461	148	0	148	0,01
				\$ 2 022	\$ (373)	\$ 1 649	0,09

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 193	\$ 210	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 318 337	€ 296 209	4 828	0	4 828	0,27
BPS	07/2023	€ 281 493	\$ 308 511	1 409	(6)	1 403	0,08
	07/2023	\$ 317 783	€ 295 608	4 726	0	4 726	0,26
	08/2023	285 856	260 523	0	(1 237)	(1 237)	(0,07)
BRC	07/2023	€ 58 828	\$ 63 633	0	(549)	(549)	(0,03)
CBK	07/2023	277 901	301 953	10	(1 248)	(1 238)	(0,07)
	07/2023	\$ 1 500	€ 1 392	18	0	18	0,00
	08/2023	283 280	260 192	978	0	978	0,05
JPM	07/2023	€ 261 055	\$ 285 046	235	0	235	0,01
	07/2023	\$ 318 471	€ 297 868	6 504	0	6 504	0,36
	08/2023	285 445	261 055	0	(243)	(243)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 6 942	\$ 7 451	3	(126)	(123)	(0,01)
	07/2023	\$ 38 120	€ 35 592	710	0	710	0,04
MYI	07/2023	€ 58 582	\$ 63 565	0	(348)	(348)	(0,02)
SCX	07/2023	\$ 19 709	€ 18 416	384	0	384	0,02
				\$ 19 805	\$ (3 757)	\$ 16 048	0,88

Au 30 juin 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	07/2023	£ 157	\$ 199	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 38	£ 30	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	£ 37	\$ 47	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 64 640	£ 52 260	1 801	0	1 801	0,10
BRC	07/2023	£ 179	\$ 225	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$ 291	£ 234	6	0	6	0,00
CBK	07/2023	£ 113	\$ 144	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 252	£ 200	3	0	3	0,00
JPM	07/2023	£ 52 214	\$ 66 020	0	(363)	(363)	(0,02)
	08/2023	\$ 66 034	£ 52 214	362	0	362	0,02
MBC	07/2023	£ 56	\$ 71	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 65 069	£ 52 560	1 752	0	1 752	0,10
MYI	07/2023	£ 64 210	\$ 51 663	1 472	0	1 472	0,08
				\$ 5 398	\$ (366)	\$ 5 032	0,28

Au 30 juin 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	07/2023	SEK 1 284 367	\$ 118 997	\$ 99	\$ (10)	\$ 89	0,00
	07/2023	\$ 10 315	SEK 110 528	3	(85)	(82)	0,00
	08/2023	114 226	K 1 231 185	0	(98)	(98)	(0,01)
BRC	07/2023	114	1 217	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2023	78 870	861 432	882	0	882	0,05
GLM	07/2023	444	4 789	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07/2023	75 679	815 016	0	(224)	(224)	(0,01)
MYI	07/2023	SEK 1 233 246	\$ 114 226	50	0	50	0,00
	07/2023	\$ 106 212	SEK 1 140 146	0	(655)	(655)	(0,04)
	08/2023	114 226	K 1 231 716	0	(49)	(49)	0,00
SCX	07/2023	SEK 2 214	\$ 207	2	0	2	0,00
	07/2023	\$ 75 470	SEK 816 396	113	0	113	0,01
				\$ 1 149	\$ (1 123)	\$ 26	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 13 543 0,74

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit 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			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
3,000 % éch. 01/08/2053	\$ 6 700	\$ (5 906)	(0,32)
4,500 % éch. 01/08/2053	26 500	(25 492)	(1,41)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (31 398)	(1,73)
Total des Investissements		\$ 2 095 487	115,18
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (276 138)	(15,18)
Actifs nets		\$ 1 819 349	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 rémunération en nature.
 (d) Titre à coupon zéro.
 (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) Titre convertible conditionnel.
 (h) 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	\$ 1 324	\$ 1 015	0,06
Brookfield Property Finance ULC	7,125	13/02/2028	09/02/2023	820	770	0,04
Citigroup, Inc.	2,572	03/06/2031	29/12/2021	8 156	6 762	0,37
Citigroup, Inc.	5,746	25/01/2026	18/01/2022	2 000	1 992	0,11
Citigroup, Inc.	6,270	17/11/2033	04/04/2023	0	0	0,00
Deutsche Bank AG	1,447	01/04/2025	23/09/2021	2 003	1 901	0,11
Oracle Corp.	3,950	25/03/2051	22/03/2021	299	227	0,01
				\$ 14 602	\$ 12 667	0,70

- (i) Des titres d'une juste valeur globale de 151 489 \$ (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 30 juin 2023.
 (j) Des titres d'une juste valeur globale de 30 629 \$ (31 décembre 2022 : 22 792 \$) 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 32 764 \$ (31 décembre 2022 : 28 652 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 1 390 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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		\$ 2 107 775		\$ 0		\$ 2 107 775
Contrats de mise en pension	0		2 319		0		2 319
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	921		15 870		0		16 791
Titres vendus à découvert	0		(31 398)		0		(31 398)
Totaux	\$ 921		\$ 2 094 566		\$ 0		\$ 2 095 487

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 30 juin 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	5,000 %	29/06/2023	03/07/2023	\$ (6 749)	\$ (6 751)	(0,37)
	5,180	15/06/2023	13/07/2023	(39 799)	(39 890)	(2,19)
	5,180	20/06/2023	13/07/2023	(90 619)	(90 763)	(4,99)
	5,190	16/06/2023	06/07/2023	(8 306)	(8 323)	(0,46)
	5,200	30/06/2023	06/07/2023	(5 684)	(5 685)	(0,31)
Total des Contrats de prise en pension					\$ (151 412)	(8,32)

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 30 juin 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	4,900 %	28/06/2023	05/07/2023	\$ (13 806)	\$ (13 812)	(0,76)
	5,090	29/06/2023	06/07/2023	(10 036)	(10 039)	(0,55)
MSC	4,700	28/06/2023	05/07/2023	(6 980)	(6 982)	(0,38)
Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos					\$ (30 833)	(1,69)

⁽¹⁾ Le montant à payer sur les opérations par vente et rachat dos-à-dos comprend 18 \$ de baisse de prix différée.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 4 808	\$ (3 670)	\$ 1 138	\$ 631	\$ (740)	\$ (109)
BPS	478	0	478	1	0	1
BRC	(984)	770	(214)	524	(240)	284
CBK	257	0	257	7 658	(7 770)	(112)
CLY	(38)	0	(38)	S/O	S/O	S/O
GLM	(7)	0	(7)	S/O	S/O	S/O
JPM	6 294	(5 460)	834	(244)	0	(244)
MBC	1 612	(770)	842	(1 588)	1 380	(208)
MYI	261	620	881	312	(100)	212
SCX	788	(220)	568	4 744	(4 520)	224
UAG	74	0	74	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	93,58	81,73
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	22,17	26,66
Autres valeurs mobilières	0,11	0,36
Contrats de mise en pension	0,13	1,11
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,10	0,46
Instruments financiers dérivés compensés	0,08	(0,30)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,74	0,96
Titres vendus à découvert	(1,73)	(0,43)
Contrats de prise en pension	(8,32)	(5,54)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	(1,69)	(5,54)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	0,85	0,41
Autriche	0,42	0,22
Belgique	1,37	0,65
Bésil	S/O	0,02
Canada	1,97	1,75
Îles Caïmans	0,10	0,27
Chili	0,37	0,44
Colombie	S/O	0,09
Chypre	S/O	0,08
République tchèque	0,24	S/O
Danemark	0,87	0,79
Finlande	0,75	0,63
France	7,56	5,16
Allemagne	3,35	2,94
Guernesey, Îles Anglo-normandes	0,24	0,32
Hong Kong	0,42	0,01

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Inde	0,66	0,96
Indonésie	0,04	S/O
Irlande	1,11	1,40
Israël	0,10	S/O
Italie	1,65	1,33
Japon	3,90	3,85
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,06	0,09
Luxembourg	0,99	1,23
Île Maurice	0,25	0,18
Mexique	0,31	0,32
Multinationales	0,47	0,63
Pays-Bas	7,13	7,21
Norvège	0,13	0,16
Pérou	0,09	0,11
Philippines	0,22	S/O
Pologne	0,08	S/O
Roumanie	0,33	0,29
Serbie	0,09	0,13
Singapour	0,38	0,35
Afrique du Sud	S/O	0,02
Corée du Sud	2,10	1,02
Espagne	1,52	1,34
Supranationales	2,87	2,90
Suède	0,64	0,70
Suisse	0,64	0,63
Thaïlande	0,01	S/O
Royaume-Uni	9,66	8,14
États-Unis	61,39	55,93
Îles Vierges britanniques	0,18	0,24
Instruments à court terme	0,35	5,81
Contrats de mise en pension	0,13	1,11
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,10	0,46
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	(0,02)
Swaps de taux d'intérêt	0,07	(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	(0,51)	(0,50)
Contrats de change à terme couverts	1,25	1,46
Titres vendus à découvert	(1,73)	(0,43)
Autres actifs et passifs à court terme	(15,18)	(10,55)
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				ALLEMAGNE				JAPON			
AUSTRALIE				ÉMISSIONS SOUVERAINES				LUXEMBOURG			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				République d'Allemagne				CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Obligation internationale du gouvernement australien				0,100 % éch. 15/04/2026 (a) € 20 992 \$ 22 392 1,79				Delos Finance SARL			
0,750 % éch. 21/11/2027 AUD 13 036 \$ 8 421 0,67				0,500 % éch. 15/04/2030 (a) 24 514 27 270 2,17				7,268 % éch. 06/10/2023 \$ 70 70 0,01			
3,000 % éch. 20/09/2025 6 306 4 328 0,35				Total Allemagne 49 662 3,96				TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Total Australie 12 755 1,02				IRLANDE				PAYS-BAS			
CANADA				TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Adagio CLO DAC				Miravet SARL			
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien				4,541 % éch. 20/07/2036 5 100 5 564 0,44				4,265 % éch. 26/05/2065 € 2 008 2 157 0,17			
4,250 % éch. 01/12/2026 (a) CAD 2 671 2 175 0,17				Ares European CLO DAC				Total Luxembourg 2 227 0,18			
ÎLES CAÏMANS				3,787 % éch. 15/04/2030 5 606 5 999 0,48				PAYS-BAS			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				3,957 % éch. 15/10/2031 4 200 4 504 0,36				TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				Aurium CLO DAC				Dutch Property Finance BV			
6,410 % éch. 16/01/2030 \$ 1 725 1 717 0,14				4,618 % éch. 23/03/2032 1 700 1 827 0,14				4,168 % éch. 28/04/2064 1 876 2 052 0,16			
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				Bain Capital Euro CLO DAC				Eurosail BV			
6,360 % éch. 15/10/2030 1 297 1 291 0,10				3,980 % éch. 20/04/2032 384 413 0,03				4,677 % éch. 17/10/2040 438 478 0,04			
Sound Point CLO Ltd.				Cairn CLO DAC				Total Pays-Bas 2 530 0,20			
6,210 % éch. 15/04/2029 2 308 2 305 0,18				3,957 % éch. 15/10/2031 1 700 1 818 0,14				NOUVELLE-ZÉLANDE			
Total Îles Caïmans 5 313 0,42				4,212 % éch. 20/10/2028 95 104 0,01				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
DANEMARK				Carlyle Euro CLO DAC				Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				3,877 % éch. 15/01/2031 796 851 0,07				2,000 % éch. 20/09/2025 NZD 10 208 6 245 0,50			
Jyske Realkredit A/S				Fidelity Grand Harbour CLO DAC				3,000 % éch. 20/09/2030 1 268 812 0,06			
0,500 % éch. 01/10/2053 DKK 19 539 1 885 0,15				4,726 % éch. 15/03/2032 3 480 3 732 0,30				Total Nouvelle-Zélande 7 057 0,56			
1,000 % éch. 01/10/2050 18 2 0,00				Harvest CLO DAC				PÉROU			
1,000 % éch. 01/10/2053 2 755 268 0,02				4,027 % éch. 15/01/2032 1 600 1 708 0,14				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
1,500 % éch. 01/10/2050 492 53 0,00				Jubilee CLO DAC				Obligation internationale du gouvernement péruvien			
1,500 % éch. 01/10/2053 15 157 1 572 0,13				4,326 % éch. 15/12/2029 250 269 0,02				5,940 % éch. 12/02/2029 PEN 700 190 0,02			
2,500 % éch. 01/10/2047 3 0 0,00				Palmer Square European Loan Funding DAC				SLOVÉNIE			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				4,227 % éch. 15/10/2031 5 551 5 966 0,48				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
0,500 % éch. 01/10/2043 10 543 1 169 0,09				Palmerston Park CLO DAC				Nova Ljubljanska Banka d.d.			
1,000 % éch. 01/10/2050 1 0 0,00				3,825 % éch. 18/04/2030 1 060 1 141 0,09				3,400 % éch. 05/02/2030 € 600 556 0,05			
2,500 % éch. 01/10/2047 13 2 0,00				St. Paul's CLO DAC				ESPAGNE			
Nykredit Realkredit A/S				4,091 % éch. 25/04/2030 4 979 5 349 0,43				TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS			
0,500 % éch. 01/10/2053 3 009 290 0,02				Total Irlande 55 385 4,42				BBVA Consumer Auto			
1,000 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00				ITALIE				0,270 % éch. 20/07/2031 276 293 0,03			
1,000 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
1,500 % éch. 01/10/2050 0 0 0,00				UniCredit SpA				Obligation internationale du gouvernement espagnol			
1,500 % éch. 01/10/2053 126 999 13 792 1,10				3,375 % éch. 31/01/2027 4 100 4 414 0,35				0,700 % éch. 30/11/2033 (a) 4 452 4 651 0,37			
2,000 % éch. 01/10/2053 8 618 985 0,08				ÉMISSIONS SOUVERAINES				Total Espagne 4 944 0,40			
2,500 % éch. 01/10/2047 2 0 0,00				Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				SUÈDE			
3,000 % éch. 01/10/2053 50 041 6 444 0,52				0,400 % éch. 15/05/2030 (a) 3 557 3 550 0,28				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
3,500 % éch. 01/10/2053 3 205 429 0,04				0,650 % éch. 15/05/2026 (a) 3 740 3 950 0,32				Obligation internationale du gouvernement suédois			
5,000 % éch. 01/10/2053 7 157 1 033 0,08				1,400 % éch. 26/05/2025 (a) 41 050 44 347 3,54				0,125 % éch. 01/12/2027 SEK 49 488 4 451 0,35			
Realkredit Danmark A/S				2,350 % éch. 15/09/2024 (a) 34 059 37 400 2,98				1,000 % éch. 01/06/2025 63 760 5 866 0,47			
1,000 % éch. 01/10/2050 7 471 787 0,06				2,400 % éch. 15/05/2039 (a) 11 223 12 848 1,03				Total Suède 10 789 0,86			
1,000 % éch. 01/10/2053 6 306 657 0,05				2,600 % éch. 15/09/2023 (a) 11 191 12 206 0,97				SUISSE			
1,500 % éch. 01/10/2050 16 225 1 740 0,14				Total Italie 118 715 9,47				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
1,500 % éch. 01/10/2053 0 0 0,00				JAPON				Credit Suisse AG			
2,500 % éch. 01/10/2047 8 1 0,00				ÉMISSIONS SOUVERAINES				5,464 % éch. 02/02/2024 \$ 1 650 1 637 0,13			
2,500 % éch. 01/10/2053 26 867 3 462 0,28				Obligation internationale du gouvernement japonais				UBS Group AG			
3,000 % éch. 01/10/2053 34 571 2,76				0,005 % éch. 10/03/2031 (a) ¥ 190 289 1 412 0,11				4,177 % éch. 16/01/2026 € 600 645 0,05			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				0,100 % éch. 10/09/2024 (a) 586 850 4 174 0,33				6,537 % éch. 12/08/2033 \$ 750 769 0,06			
Obligation internationale du gouvernement danois				0,100 % éch. 10/03/2025 (a) 1 382 217 9 874 0,79				Total Suisse 3 051 0,24			
0,100 % éch. 15/11/2023 (a) 13 335 1 956 0,16				0,100 % éch. 10/03/2026 (a) 2 872 970 20 821 1,66				ROYAUME-UNI			
Total Danemark 36 527 2,92				0,100 % éch. 10/03/2028 (a) 1 592 571 11 614 0,93				TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
FRANCE				ÉMISSIONS SOUVERAINES				Alba PLC			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Obligation internationale du gouvernement français				5,191 % éch. 17/03/2039 £ 815 996 0,08			
Obligation internationale du gouvernement français				0,100 % éch. 01/03/2025 (a) € 10 156 10 881 0,87				Atlas Funding PLC			
0,100 % éch. 01/03/2026 (a) 3 970 4 245 0,34				0,100 % éch. 01/03/2028 (a) 14 334 15 354 1,23				5,432 % éch. 25/07/2058 2 102 2 670 0,21			
0,100 % éch. 01/03/2029 (a) 590 626 0,05				0,100 % éch. 25/07/2031 (a) 8 070 8 560 0,68							
0,100 % éch. 25/07/2036 (a) 241 247 0,02				0,100 % éch. 25/07/2036 (a) 241 247 0,02							
0,100 % éch. 25/07/2038 (a) 230 234 0,02				0,250 % éch. 25/07/2024 (a) 15 310 16 548 1,32							
0,250 % éch. 25/07/2024 (a) 15 310 16 548 1,32				0,550 % éch. 01/03/2039 (a) 2 981 3 245 0,26							
0,550 % éch. 01/03/2039 (a) 2 981 3 245 0,26				1,850 % éch. 25/07/2027 (a) 14 015 16 071 1,28							
1,850 % éch. 25/07/2027 (a) 14 015 16 071 1,28				2,100 % éch. 25/07/2023 (a) 11 654 12 701 1,01							
2,100 % éch. 25/07/2023 (a) 11 654 12 701 1,01				Total France 88 712 7,08							

Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return 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
Canada Square Funding PLC	£ 3 849	\$ 4 865	0,39	1,250 % éch. 22/11/2027 (a)	£ 59 804	\$ 76 806	6,13	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (a)			
5,316 % éch. 17/01/2059				4,250 % éch. 07/12/2049	3 200	3 934	0,31	0,125 % éch. 15/07/2024	\$ 34 617	\$ 33 583	2,68
5,682 % éch. 17/06/2058	1 713	2 166	0,17					0,125 % éch. 15/10/2024 (c)	56 509	54 512	4,35
5,852 % éch. 17/06/2058	1 415	1 791	0,14	Total Royaume-Uni		141 187	11,27	0,125 % éch. 15/04/2025 (d)	54 685	52 030	4,15
Canterbury Finance PLC						196 282	15,66	0,125 % éch. 15/10/2025	52 370	49 658	3,96
5,377 % éch. 16/05/2058	487	618	0,05	ÉTATS-UNIS				0,125 % éch. 15/04/2026 (c)	53 237	49 930	3,98
Eurosaill PLC				TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				0,125 % éch. 15/07/2026 (c)	77 561	72 873	5,82
3,619 % éch. 13/03/2045	€ 730	786	0,06	Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through				0,125 % éch. 15/10/2026 (c)	70 151	65 598	5,23
3,736 % éch. 10/06/2044	739	799	0,06	Certificates				0,125 % éch. 15/04/2027	22 452	20 787	1,66
3,736 % éch. 10/09/2044	983	1 060	0,08	6,050 % éch. 25/10/2034	\$ 456	455	0,04	0,125 % éch. 15/01/2030	2 240	2 010	0,16
5,140 % éch. 13/03/2045	£ 905	1 138	0,09	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				0,125 % éch. 15/07/2030	7 335	6 581	0,53
Great Hall Mortgages PLC				3,405 % éch. 25/03/2036	26	26	0,00	0,125 % éch. 15/07/2031	4 844	4 297	0,34
5,152 % éch. 18/03/2059	18	23	0,00	Fremont Home Loan Trust				0,125 % éch. 15/01/2032	1 641	1 446	0,12
5,172 % éch. 18/06/2038	450	568	0,05	5,885 % éch. 25/07/2035	1	1	0,00	0,125 % éch. 15/02/2051	350	234	0,02
London Wall Mortgage Capital PLC				Renaissance Home Equity Loan Trust				0,250 % éch. 15/01/2025 (c)	92 331	88 522	7,06
5,502 % éch. 15/05/2052	983	1 240	0,10	6,090 % éch. 25/05/2034	1 925	1 733	0,14	0,250 % éch. 15/02/2050	472	330	0,03
Polaris PLC				Structured Asset Investment Loan Trust				0,375 % éch. 15/07/2025 (d)	57 812	55 332	4,42
5,640 % éch. 23/10/2059	2 802	3 538	0,28	6,100 % éch. 25/10/2033	776	753	0,06	0,375 % éch. 15/01/2027 (c)	69 186	64 934	5,18
6,154 % éch. 27/05/2057	689	877	0,07			2 968	0,24	0,375 % éch. 15/07/2027	47 738	44 763	3,57
Precise Mortgage Funding PLC				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				0,500 % éch. 15/01/2028 (c)	55 211	51 660	4,12
5,657 % éch. 16/10/2056	268	340	0,03	Sabine Pass Liquefaction LLC		200	0,02	0,625 % éch. 15/01/2024	31	31	0,00
6,065 % éch. 12/12/2055	1 173	1 496	0,12	5,750 % éch. 15/05/2024	200	200	0,02	0,625 % éch. 15/01/2026 (c)	72 033	68 699	5,48
RMAC Securities PLC				TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				0,625 % éch. 15/07/2032 (c)	6 368	5 856	0,47
5,134 % éch. 12/06/2044	1 495	1 824	0,15	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				0,750 % éch. 15/07/2028	36 371	34 477	2,75
Rochester Financing PLC				5,690 % éch. 25/08/2036	0	0	0,00	0,750 % éch. 15/02/2045	1 932	1 598	0,13
5,602 % éch. 18/12/2044	2 951	3 707	0,30	5,790 % éch. 25/10/2028	6	5	0,00	0,875 % éch. 15/01/2029	26 066	24 683	1,97
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				Structured Asset Mortgage Investments Trust				0,875 % éch. 15/02/2047	754	633	0,05
5,221 % éch. 20/01/2054	4 047	5 119	0,41	5,626 % éch. 19/04/2035	285	258	0,02	1,375 % éch. 15/02/2044	1 171	1 104	0,09
Stratton Mortgage Funding PLC				5,646 % éch. 19/07/2035	48	44	0,00	1,625 % éch. 15/10/2027 (c)	63 482	62 569	4,99
5,765 % éch. 12/03/2052	754	955	0,08	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				2,125 % éch. 15/02/2041	831	892	0,07
Towd Point Mortgage Funding PLC				5,730 % éch. 25/07/2045	398	371	0,03				
5,841 % éch. 20/07/2045	2 174	2 766	0,22	5,790 % éch. 25/07/2045	76	72	0,01	Total États-Unis		919 622	73,38
6,546 % éch. 20/02/2054	562	715	0,06			750	0,06	INSTRUMENTS À COURT TERME			
Tower Bridge Funding PLC				AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				BILLETS DE TRÉSORERIE			
5,527 % éch. 20/11/2063	2 222	2 811	0,22	Ginnie Mae				AT+T, Inc.			
5,629 % éch. 20/12/2063	1 389	1 758	0,14	3,858 % éch. 20/08/2068	1 085	1 057	0,08	5,700 % éch. 19/03/2024	3 800	3 638	0,29
5,991 % éch. 20/10/2064	4 500	5 753	0,46	5,452 % éch. 20/08/2066	184	184	0,01	Total des Instruments à court terme		3 638	0,29
Tudor Rose Mortgages				5,866 % éch. 20/08/2072 - 20/04/2073	10 089	9 994	0,80	Total des Valeurs mobilières		\$ 1 697 365	135,45
5,509 % éch. 20/06/2048	1 516	1 917	0,15	5,966 % éch. 20/10/2072	5 037	4 991	0,40	ACTIONS			
Twin Bridges PLC				6,067 % éch. 20/03/2073	5 700	5 636	0,45	FONDS D'INVESTISSEMENT			
6,115 % éch. 12/12/2054	2 197	2 799	0,22	6,166 % éch. 20/05/2073	3 200	3 203	0,26	ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
		55 095	4,39	OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				PIMCO Select Funds plc -			
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				Fonds PIMCO			
Bon du Trésor britannique				4,500 % éch. 01/09/2052	19 690	18 946	1,51	US Dollar Short-Term Floating			
0,125 % éch. 22/03/2024 (a)	43 714	54 507	4,35	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				NAV Fund (b)	18 999	189	0,02
0,125 % éch. 22/03/2026 (a)	203	249	0,02	4,000 % éch. 01/08/2053	30 500	28 650	2,29	Total des Fonds d'investissement		\$ 189	0,02
0,125 % éch. 22/11/2036 (a)	1 146	1 346	0,11	4,500 % éch. 01/08/2053	37 700	36 265	2,89				
0,125 % éch. 22/11/2056 (a)	554	556	0,04			108 926	8,69				
0,625 % éch. 22/11/2042 (a)	1 526	1 845	0,15								
0,625 % éch. 22/03/2045 (a)	819	962	0,08								
0,625 % éch. 22/10/2050	1 900	982	0,08								

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 7 529	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	\$ (7 680)	\$ 7 529	\$ 7 530	0,60	
Total des Contrats de mise en pension							\$ (7 680)	\$ 7 529	\$ 7 530	0,60

(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 septembre	Court	09/2023	16	\$ 6	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Long	09/2023	326	(565)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	84	(86)	(0,01)

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-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	110	\$ 118	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	476	468	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	56	(122)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Long	09/2023	61	(6)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	1 342	1 323	0,11
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	37	(133)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	16	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	1 181	1 661	0,13
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	291	(275)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	543	411	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	51	(3)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	173	(341)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	222	92	0,01
				\$ 2 548	0,20

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 113,000	21/07/2023	214	\$ (151)	\$ (238)	(0,02)

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 2 310 0,18

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
General Electric Co.	1,000 %	20/12/2023	\$ 500	\$ (5)	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 recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250 %	20/09/2053	£ 1 900	\$ 170	0,01
À payer ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	34 500	(1 272)	(0,10)
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,670	10/01/2033	4 100	62	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2029	¥ 3 582 000	(260)	(0,02)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,435	20/06/2029	1 418 000	(70)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,880	25/01/2052	\$ 4 300	(1 205)	(0,10)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,888	21/11/2053	2 400	(605)	(0,05)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,865	13/02/2054	17 200	369	0,03
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,085	13/02/2034	44 400	(798)	(0,06)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	20/12/2053	1 900	(3)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,400	23/02/2033	2 700	(40)	0,00
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2033	7 300	(58)	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,250	20/12/2025	68 600	412	0,03
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/07/2023	4 300	(17)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€ 2 200	(98)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	32 500	(540)	(0,04)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	16 300	40	0,00
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	79 500	126	0,01
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	53 200	(28)	0,00
À recevoir	CPTFEMU	1,005	15/02/2025	18 100	1 802	0,14
À payer	CPTFEMU	1,355	15/02/2050	1 200	(135)	(0,01)
À payer	CPTFEMU	1,375	15/02/2040	1 600	(213)	(0,02)
À recevoir	CPTFEMU	1,380	15/03/2031	4 800	593	0,05
À recevoir	CPTFEMU	1,500	15/07/2031	7 040	901	0,07
À payer	CPTFEMU	1,946	15/03/2048	800	(193)	(0,02)
À recevoir	CPTFEMU	2,359	15/08/2030	1 500	75	0,01
À payer	CPTFEMU	2,421	15/05/2052	330	(54)	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,470	15/07/2032	1 600	78	0,01
À payer	CPTFEMU	2,488	15/05/2037	2 290	(175)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	2,550	15/04/2052	300	45	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,570	15/06/2032	1 200	51	0,00
À payer	CPTFEMU	2,580	15/03/2052	1 400	(185)	(0,01)
À payer	CPTFEMU	2,590	15/12/2052	1 700	(97)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	2,600	15/05/2032	3 000	140	0,01
À payer	CPTFEMU	2,700	15/04/2053	5 500	(10)	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,720	15/06/2032	1 800	58	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,975	15/08/2027	19 700	226	0,02
À recevoir	CPTFEMU	3,000	15/05/2027	5 400	137	0,01
À recevoir	CPTFEMU	3,130	15/05/2027	100	3	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Low Duration 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 payer	CPTFEMU	3,520 %	15/09/2024	€ 5 200	\$ (56)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,720	15/09/2024	3 300	(23)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,850	15/09/2024	7 700	(48)	0,00
À recevoir	CPURNSA	1,794	24/08/2027	\$ 6 700	168	0,01
À recevoir	CPURNSA	1,798	25/08/2027	3 400	86	0,01
À payer	CPURNSA	1,883	20/11/2029	7 400	(202)	(0,02)
À recevoir	CPURNSA	1,890	27/08/2027	6 500	167	0,01
À payer	CPURNSA	1,954	03/06/2029	4 700	(132)	(0,01)
À payer	CPURNSA	1,998	25/07/2029	4 300	(124)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	2,311	24/02/2031	6 600	208	0,02
À payer	CPURNSA	2,335	05/02/2028	6 110	(195)	(0,02)
À payer	CPURNSA	2,353	09/05/2028	960	(31)	0,00
À payer	CPURNSA	2,364	10/05/2028	7 960	(257)	(0,02)
À payer	CPURNSA	2,379	09/07/2028	1 900	(62)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	2,419	05/03/2026	400	12	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,690	01/06/2026	1 300	38	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,703	25/05/2026	2 450	72	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,768	13/05/2026	3 500	104	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,813	14/05/2026	1 600	48	0,00
À payer	FRCPXTOB	1,280	15/11/2034	€ 1 700	(225)	(0,02)
À payer	FRCPXTOB	1,410	15/11/2039	2 000	(291)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,330	15/01/2025	£ 400	(55)	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	3,346	15/05/2030	550	(55)	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	3,530	15/10/2031	7 260	(875)	(0,07)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,566	15/03/2036	1 400	(62)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,850	15/09/2024	2 500	(364)	(0,03)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,125	15/09/2032	480	24	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,130	15/09/2032	2 120	106	0,01
À payer	IPC Royaume-Uni	4,288	15/02/2032	2 200	(124)	(0,01)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,480	15/09/2023	1 300	182	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,330	15/06/2024	8 800	386	0,03
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,440	15/05/2024	1 500	104	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,600	15/05/2024	2 200	143	0,01
					\$ (2 101)	(0,17)

Total des Instruments financiers dérivés compensés

\$ (2 106) (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.

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
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	3-Month USD-LIBOR	Receive	2,237 %	17/11/2023	8 700	\$ 540	\$ 1 909	0,15

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)	\$ (85)	(0,01)
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)	\$ (85)	(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	3,750 %	12/09/2023	33 600	\$ (95)	\$ (39)	0,00
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,340	17/11/2023	43 000	(542)	(3 171)	(0,25)
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,420	21/09/2023	72 900	(415)	(312)	(0,03)
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	12/09/2023	46 800	(131)	(54)	0,00
						\$ (1 183)	\$ (3 576)	(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
GST	Indice CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17/10/2057	\$ 600	\$ (40)	\$ 40	\$ 0	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	1 400	(3)	(12)	(15)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17/09/2058	894	(79)	77	(2)	0,00
					\$ (122)	\$ 105	\$ (17)	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	07/2023	AUD	441	\$ 289	\$ 0	\$ (5)	0,00	
	07/2023	\$	1 606	AUD 2 420	5	5	0,00	
	08/2023	AUD	2 420	\$ 1 607	0	(5)	0,00	
BOA	07/2023		3 551		0	(45)	0,00	
	07/2023	DKK	253 510	36 608	0	(537)	(0,04)	
	07/2023	€	13 541	14 578	0	(195)	(0,02)	
	07/2023	¥	202 000	1 452	55	0	55	0,00
	07/2023	NZD	2 917	1 770	0	(17)	(17)	0,00
	07/2023	SEK	45	4	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	\$	17 228	DKK 117 135	0	(65)	(0,01)	
	07/2023		3 593	£ 2 841	19	0	19	0,00
	08/2023	DKK	116 939	\$ 17 228	65	0	65	0,01
	07/2023	AUD	485	317	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	¥	8 169 087	58 798	2 278	0	2 278	0,18
	07/2023	NZD	69	42	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$	1 146	AUD 1 730	6	0	6	0,00
	07/2023		333 069	€ 303 979	0	(1 429)	(1 429)	(0,11)
	07/2023		2 284	£ 1 794	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023	AUD	1 730	\$ 1 147	0	(6)	(6)	0,00
CBK	08/2023	€	303 979	333 537	1 442	0	1 442	0,11
	07/2023	AUD	1 533	1 000	0	(20)	(20)	0,00
	07/2023	CAD	3 086	2 265	0	(67)	(67)	(0,01)
	07/2023	DKK	900	129	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	€	2 928	3 142	0	(52)	(52)	(0,01)
JPM	07/2023	£	3 483	4 406	0	(22)	(22)	0,00
	07/2023	AUD	3 411	2 230	0	(41)	(41)	0,00
	07/2023	\$	19 934	¥ 2 850 740	0	(210)	(210)	(0,02)
MBC	08/2023	¥	2 838 626	\$ 19 934	211	0	211	0,02
	09/2023	PEN	9 795	2 660	0	(26)	(26)	0,00
	07/2023	€	3 029	3 277	0	(28)	(28)	0,00
	07/2023	£	165 640	205 040	0	(5 547)	(5 547)	(0,44)
MYI	07/2023	SEK	1 394	129	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	4 954	€ 4 615	81	0	81	0,01
	07/2023	£	59	\$ 75	1	(1)	0	0,00
	07/2023	NZD	194	117	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	SEK	107 609	10 025	62	0	62	0,00
	07/2023	\$	15 314	DKK 104 463	0	(8)	(8)	0,00
	07/2023		1 626	€ 1 492	1	0	1	0,00
	07/2023		1 767	£ 1 400	13	0	13	0,00
	07/2023		10 116	SEK 109 217	0	(4)	(4)	0,00
	08/2023	DKK	104 289	\$ 15 314	8	0	8	0,00
RBC	08/2023	SEK	109 082	10 116	4	0	4	0,00
	07/2023	\$	1 168	£ 914	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07/2023	AUD	4 816	\$ 3 147	0	(59)	(59)	(0,01)
	07/2023	NZD	7 598	4 613	0	(42)	(42)	0,00
	07/2023	\$	2 359	AUD 3 554	6	0	6	0,00
SOG	08/2023	AUD	3 554	\$ 2 361	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023		2 915	1 907	0	(33)	(33)	0,00
TOR	07/2023	€	289 096	310 992	0	(4 412)	(4 412)	(0,35)
	07/2023	AUD	1 543	1 009	0	(18)	(18)	0,00
	07/2023	\$	2 889	AUD 4 374	23	0	23	0,00
	07/2023		2 332	CAD 3 086	2	(2)	0	0,00
	07/2023		203 428	£ 160 091	104	0	104	0,01
	07/2023		38 333	¥ 5 519 964	0	(142)	(142)	(0,01)
	07/2023		6 564	NZD 10 778	39	0	39	0,00
	08/2023	AUD	4 374	\$ 2 891	0	(23)	(23)	0,00
	08/2023	CAD	3 085	2 332	2	(2)	0	0,00
	08/2023	£	160 091	203 472	0	(100)	(100)	(0,01)
	08/2023	¥	5 496 554	38 333	143	0	143	0,01
	08/2023	NZD	10 778	6 563	0	(39)	(39)	0,00
	UAG	07/2023	AUD	353	231	0	(4)	(4)
07/2023		\$	4 655	AUD 6 971	9	(24)	(15)	0,00
08/2023		AUD	6 971	\$ 4 658	25	(10)	15	0,00
				\$ 4 604	\$ (13 266)	\$ (8 662)	(0,69)	

Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	
BOA	07/2023	CHF	\$ 60	\$ 66	\$ 0	\$ 0	0,00	
BPS	07/2023		4 263	4 766	2	2	0,00	
	07/2023	\$	6 484	CHF 5 865	72	0	0,01	
	08/2023		4 766	4 250	0	(2)	0,00	
MBC	07/2023	CHF	190	\$ 212	0	0	0,00	
MYI	07/2023		192	212	0	(3)	0,00	
	07/2023	\$	2	CHF 1	0	0	0,00	
RBC	07/2023	CHF	2	\$ 3	0	0	0,00	
SCX	07/2023		39	44	0	0	0,00	
	07/2023	\$	4 688	CHF 4 212	20	0	0,00	
UAG	07/2023	CHF	4 383	\$ 4 890	0	(10)	0,00	
	07/2023	\$	4 229	CHF 3 800	18	0	0,00	
	08/2023		4 870	4 353	10	0	0,00	
					\$ 122	\$ (15)	\$ 107	0,01

Au 30 juin 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	
BOA	07/2023	€	14 295	\$ 15 619	\$ 25	\$ (2)	\$ 23	0,00
	07/2023	\$	208 813	€ 194 298	3 166	0	3 166	0,25
BPS	07/2023	€	191 441	\$ 209 717	876	(21)	855	0,07
	07/2023	\$	209 584	€ 194 960	3 118	0	3 118	0,25
	08/2023		191 522	174 549	0	(829)	(829)	(0,07)
CBK	07/2023	€	189 507	\$ 206 009	21	(764)	(743)	(0,06)
	08/2023	\$	188 532	€ 173 166	651	0	651	0,05
JPM	07/2023	€	173 166	\$ 189 080	156	0	156	0,01
	08/2023	\$	189 345	€ 173 166	0	(161)	(161)	(0,01)
MBC	07/2023	€	14 483	\$ 15 663	23	(161)	(138)	(0,01)
SOG	07/2023	\$	209 726	€ 194 960	2 975	0	2 975	0,24
					\$ 11 011	\$ (1 938)	\$ 9 073	0,72

Au 30 juin 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	07/2023	£	10 645	\$ 13 529	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	07/2023	\$	126	£ 100	1	0	1	0,00
BPS	07/2023	£	54 951	\$ 44 420	1 525	(2)	1 523	0,12
BRC	07/2023	£	1 645	\$ 2 084	2	(9)	(7)	0,00
	07/2023	\$	50	£ 41	1	0	1	0,00
CBK	07/2023	£	7 686	\$ 9 775	23	(19)	4	0,00
	07/2023	\$	95	£ 76	1	0	1	0,00
JPM	07/2023	£	33 814	\$ 42 754	0	(235)	(235)	(0,02)
	08/2023	\$	42 763	£ 33 814	235	0	235	0,02
MBC	07/2023	£	4 959	\$ 6 341	36	0	36	0,00
	07/2023	\$	54 559	£ 44 074	1 475	0	1 475	0,12
MYI	07/2023	£	54 675	\$ 43 992	1 253	0	1 253	0,10
RBC	07/2023	£	5 877	\$ 7 477	5	0	5	0,00
TOR	07/2023	£	34 384	\$ 43 692	0	(22)	(22)	0,00
	08/2023	\$	43 702	£ 34 384	22	0	22	0,00
					\$ 4 579	\$ (292)	\$ 4 287	0,34

Au 30 juin 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	
BRC	07/2023	\$	146 236	SGD 197 875	\$ 0	\$ (25)	\$ (25)	0,00
GLM	07/2023		40 533	54 427	0	(316)	(316)	(0,02)
MBC	07/2023		133 531	180 414	0	(222)	(222)	(0,02)
SCX	07/2023		118 195	159 971	8	0	8	0,00
					\$ 8	\$ (563)	\$ (555)	(0,04)

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 2 481 0,20

Total des Investissements

\$ 1 707 768 136,28

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (454 611) (36,28)

Actifs nets

\$ 1 253 157 100,00

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 montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(b) Affilié au Fonds.

(c) Des titres d'une juste valeur globale de 408 709 \$ (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 30 juin 2023.

(d) Des titres d'une juste valeur globale de 9 181 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2022 : 286 \$) a été reçu en garantie en vertu des contrats cadres de transactions à terme au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 17 212 \$ (31 décembre 2022 : 13 037 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 6 410 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 1 691 697	\$ 5 668	\$ 1 697 365
Fonds d'investissement	189	0	0	189
Contrats de mise en pension	0	7 529	0	7 529
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	1 096	1 589	0	2 685
Totaux	\$ 1 285	\$ 1 700 815	\$ 5 668	\$ 1 707 768

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 30 juin 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	5,170 %	20/06/2023	13/07/2023	\$ (65 967)	\$ (66 071)	(5,27)
	5,170	21/06/2023	13/07/2023	(92 213)	(92 345)	(7,37)
	5,170	22/06/2023	13/07/2023	(73 094)	(73 189)	(5,84)
	5,180	15/06/2023	13/07/2023	(72 713)	(72 880)	(5,82)
	5,180	26/06/2023	17/07/2023	(20 757)	(20 772)	(1,66)
	5,180	30/06/2023	13/07/2023	(51 678)	(51 685)	(4,12)
	5,190	30/06/2023	03/07/2023	(13 640)	(13 642)	(1,09)
	5,220	30/06/2023	06/07/2023	(18 305)	(18 308)	(1,46)
	Total des Contrats de prise en pension				\$ (408 892)	(32,63)

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 30 juin 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
TDM	5,180 %	28/06/2023	12/07/2023	\$ (3 193)	\$ (3 194)	(0,26)
	5,200	29/06/2023	13/07/2023	(2 574)	(2 574)	(0,21)
	5,210	29/06/2023	06/07/2023	(3 442)	(3 444)	(0,27)
Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos				\$ (9 212)	(0,74)	

⁽¹⁾ Le montant à payer sur les opérations par vente et rachat dos-à-dos comprend 12\$ de baisse de prix différée.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ (5)	\$ 10	\$ 5	\$ 1 129	\$ (820)	\$ 309
BOA	2 465	(2 050)	415	2 665	(2 510)	155
BPS	6 981	(6 190)	791	(530)	450	(80)
BRC	(31)	0	(31)	166	0	166
CBK	(251)	280	29	6 045	(6 000)	45
DUB	(1 262)	1 020	(242)	(1 270)	1 230	(40)
FAR	(312)	430	118	S/O	S/O	S/O
GLM	(401)	290	(111)	1 583	(1 500)	83
GST	0	0	0	(1 050)	1 130	80
JPM	(125)	0	(125)	(314)	640	326
MBC	(4 343)	3 280	(1 063)	(485)	340	(145)
MYC	S/O	S/O	S/O	(12)	30	18
MYI	1 325	(950)	375	(2 046)	1 530	(516)
RBC	(1)	0	(1)	317	(280)	37
RYL	S/O	S/O	S/O	773	(450)	323
SAL	(15)	10	(5)	(11)	10	(1)
SCX	(73)	0	(73)	5 105	(4 920)	185
SOG	(1 470)	1 090	(380)	S/O	S/O	S/O
TOR	(13)	0	(13)	31	(60)	(29)
UAG	12	0	12	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	126,66	114,97
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	8,79	6,69
Autres valeurs mobilières	S/O	0,13
Fonds d'investissement	0,02	0,91
Contrats de mise en pension	0,60	0,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,18	0,26
Instruments financiers dérivés compensés	(0,17)	0,40
Instruments financiers dérivés hors cote	0,20	0,88
Contrats de prise en pension	(32,63)	(19,18)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	(0,74)	(5,83)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	1,02	1,01
Canada	0,17	0,16
Îles Caïmans	0,42	0,55
Danemark	2,92	3,10
France	7,08	5,15
Allemagne	3,96	4,63
Irlande	4,42	3,76
Italie	9,47	6,49
Japon	5,14	5,03
Luxembourg	0,18	0,17
Pays-Bas	0,20	0,19
Nouvelle-Zélande	0,56	0,52
Pérou	0,02	0,09
Slovénie	0,05	0,04
Espagne	0,40	0,35
Suède	0,86	0,82
Suisse	0,24	S/O
Royaume-Uni	15,66	14,56
États-Unis	82,39	75,17
Instruments à court terme	0,29	S/O
Fonds d'investissement	0,02	0,91
Contrats de mise en pension	0,60	0,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,20	0,26
Options vendues		
Options sur 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	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,17)	0,40
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,15	0,27
Options vendues		
Options plafonnées sur l'inflation	(0,01)	(0,01)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,28)	(0,57)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,00
Contrats de change à terme	(0,69)	(0,55)
Contrats de change à terme couverts	1,03	1,74
Autres actifs et passifs à court terme	(36,28)	(24,32)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES								
AUSTRALIE								
ÉMISSIONS SOUVERAINES								
Obligation internationale du gouvernement australien								
0,250 % éch. 21/11/2032	AUD	18 952	\$	11 060	0,44			
0,750 % éch. 21/11/2027		19 495		12 601	0,50			
2,000 % éch. 21/08/2035		4 902		3 361	0,14			
Total Australie		27 022		1,08				
BELGIQUE								
ÉMISSIONS SOUVERAINES								
Obligation internationale du gouvernement belge								
1,400 % éch. 22/06/2053	€	2 500		1 742	0,07			
CANADA								
ÉMISSIONS SOUVERAINES								
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien								
0,500 % éch. 01/12/2050 (b)	CAD	9 264		5 604	0,22			
1,250 % éch. 01/12/2047 (b)		11 769		8 527	0,34			
1,500 % éch. 01/12/2044 (b)		10 875		8 224	0,33			
3,000 % éch. 01/12/2036 (b)		4 251		3 786	0,15			
4,000 % éch. 01/12/2031 (b)		12 833		11 585	0,46			
Total Canada		37 726		1,50				
ÎLES CAÏMANS								
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS								
BlueMountain CLO Ltd.								
6,340 % éch. 15/07/2031	\$	3 600		3 553	0,14			
Catamaran CLO Ltd.								
6,373 % éch. 22/04/2030		6 527		6 488	0,26			
Denali Capital CLO Ltd.								
6,310 % éch. 15/04/2031		498		491	0,02			
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.								
6,373 % éch. 15/09/2037		4 732		4 669	0,19			
Magnette Ltd.								
6,240 % éch. 15/04/2031		589		586	0,02			
OZLM Ltd.								
6,348 % éch. 16/05/2030		4 517		4 485	0,18			
Regatta Funding Ltd.								
6,330 % éch. 17/07/2031		6 000		5 947	0,24			
Starwood Commercial Mortgage Trust								
6,296 % éch. 15/07/2038		3 255		3 228	0,13			
Venture CLO Ltd.								
6,311 % éch. 07/09/2030		1 121		1 112	0,04			
6,350 % éch. 20/01/2029		2 747		2 728	0,11			
Voya CLO Ltd.								
6,162 % éch. 18/01/2029		1 536		1 529	0,06			
Total Îles Caïmans		34 816		1,39				
DANEMARK								
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS								
DLR Kredit A/S								
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	3 349		361	0,02			
Jyske Realkredit A/S								
1,000 % éch. 01/10/2050		49		5	0,00			
1,000 % éch. 01/10/2053		12		1	0,00			
1,500 % éch. 01/10/2050		37		4	0,00			
1,500 % éch. 01/10/2053		8 549		943	0,04			
2,500 % éch. 01/10/2047		3		0	0,00			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab								
0,500 % éch. 01/10/2043		27 907		3 094	0,12			
0,500 % éch. 01/10/2053		0		0	0,00			
1,000 % éch. 01/10/2050		3 069		304	0,01			
1,500 % éch. 01/10/2053		119 227		12 607	0,50			
2,500 % éch. 01/10/2047		15		2	0,00			
Nykredit Realkredit A/S								
0,500 % éch. 01/10/2053		13		1	0,00			
1,000 % éch. 01/10/2050		0		0	0,00			
1,000 % éch. 01/10/2053		24		2	0,00			
1,500 % éch. 01/10/2050		0		0	0,00			
1,500 % éch. 01/10/2053		13 724		1 450	0,06			
2,000 % éch. 01/10/2053		49 231		5 625	0,22			
2,500 % éch. 01/10/2047		3		0	0,00			
3,000 % éch. 01/10/2053		11 849		1 526	0,06			
3,500 % éch. 01/10/2053		56 276		7 534	0,30			
5,000 % éch. 01/10/2053		4 374		631	0,03			
FRANCE								
ÉMISSIONS SOUVERAINES								
Obligation internationale du gouvernement danois								
0,100 % éch. 15/11/2023 (b)		109 791		16 107	0,64			
Total Danemark				72 552	2,89			
ALLEMAGNE								
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS								
Landwirtschaftliche Rentenbank								
0,875 % éch. 15/12/2026	€	7 600		8 215	0,33			
ÉMISSIONS SOUVERAINES								
République d'Allemagne								
0,100 % éch. 15/04/2046 (b)	€	13 564		15 380	0,61			
Total Allemagne				23 595	0,94			
IRLANDE								
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS								
Adagio CLO DAC								
3,897 % éch. 15/10/2031		1 700		1 819	0,07			
3,965 % éch. 10/10/2031		5 800		6 209	0,25			
4,541 % éch. 20/07/2036		11 600		12 656	0,50			
Ares European CLO								
3,837 % éch. 15/10/2030		7 353		7 873	0,31			
Ares European CLO DAC								
3,957 % éch. 15/10/2031		2 200		2 359	0,09			
4,050 % éch. 20/04/2032		600		642	0,03			
Armada Euro CLO DAC								
3,897 % éch. 15/07/2031		4 398		4 694	0,19			
4,083 % éch. 15/11/2031		5 510		5 888	0,23			
Avoca CLO DAC								
3,885 % éch. 12/01/2031		5 483		5 875	0,23			
Bain Capital Euro CLO DAC								
3,980 % éch. 20/04/2032		3 652		3 922	0,16			
Black Diamond CLO DAC								
4,303 % éch. 15/05/2032		7 400		7 899	0,31			
Blackrock European CLO DAC								
4,426 % éch. 15/12/2032		1 900		2 019	0,08			
BNPP AM Euro CLO DAC								
4,031 % éch. 22/07/2032		3 150		3 358	0,13			
Bosphorus CLO DAC								
4,346 % éch. 15/12/2030		2 484		2 669	0,11			
Cairn CLO DAC								
3,842 % éch. 30/04/2031		3 450		3 688	0,15			
3,957 % éch. 15/10/2031		4 500		4 812	0,19			
4,212 % éch. 20/10/2028		115		125	0,01			
Carlyle Euro CLO DAC								
3,877 % éch. 15/01/2031		4 082		4 359	0,17			
3,953 % éch. 15/08/2030		2 898		3 091	0,12			
4,213 % éch. 15/08/2032		5 400		5 759	0,23			
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC								
3,927 % éch. 15/07/2030		944		1 015	0,04			
ITALIE								
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS								
UniCredit SpA								
3,375 % éch. 31/01/2027		7 000		7 536	0,30			
ÉMISSIONS SOUVERAINES								
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro								
0,400 % éch. 15/05/2030 (b)		26 207		26 154	1,04			
1,250 % éch. 15/09/2032 (b)		9 302		9 764	0,39			
1,300 % éch. 15/05/2028 (b)		58 612		62 740	2,50			
1,400 % éch. 26/05/2025 (b)		70 272		75 914	3,02			
2,400 % éch. 15/05/2039 (b)		40 342		46 185	1,84			
				220 757	8,79			
Total Italie				228 293	9,09			
CONTEGO CLO DAC								
3,851 % éch. 23/01/2030	€	1 097	\$	1 173	0,05			
CVC Cordatus Loan Fund DAC								
4,008 % éch. 27/01/2031		988		1 059	0,04			
4,156 % éch. 15/09/2031		2 799		2 989	0,12			
Dryden Euro CLO DAC								
3,837 % éch. 15/04/2033		4 200		4 482	0,18			
4,183 % éch. 15/05/2034		2 500		2 669	0,11			
Euro-Galaxy CLO DAC								
3,831 % éch. 24/04/2034		5 600		5 950	0,24			
Harvest CLO DAC								
1,040 % éch. 15/07/2031		1 000		995	0,04			
3,880 % éch. 20/10/2031		2 200		2 351	0,09			
3,937 % éch. 15/07/2031		7 400		7 879	0,31			
4,027 % éch. 15/01/2032		3 700		3 950	0,16			
Jubilee CLO DAC								
3,777 % éch. 15/04/2030		600		639	0,03			
3,827 % éch. 15/04/2031		1 700		1 810	0,07			
4,326 % éch. 15/12/2029		267		288	0,01			
Laurelin DAC								
3,920 % éch. 20/10/2031		3 800		4 071	0,16			
Madison Park Euro Funding DAC								
3,977 % éch. 15/07/2031		7 300		7 768	0,31			
Man GLG Euro CLO DAC								
3,857 % éch. 15/10/2030		2 638		2 826	0,11			
4,047 % éch. 15/01/2030		396		426	0,02			
Oak Hill European Credit Partners DAC								
3,940 % éch. 20/10/2031		1 900		2 019	0,08			
OCP Euro CLO DAC								
4,091 % éch. 22/09/2034		7 300		7 757	0,31			
Palmer Square European Loan Funding DAC								
3,897 % éch. 15/10/2031		4 034		4 314	0,17			
3,907 % éch. 15/07/2031		2 188		2 331	0,09			
Purple Finance CLO DAC								
4,061 % éch. 20/01/2031		1 081		1 168	0,05			
Segovia European CLO DAC								
3,945 % éch. 18/01/2031		881		944	0,04			
4,080 % éch. 20/07/2032		6 400		6 803	0,27			
Tikehau CLO DAC								
4,144 % éch. 04/08/2034		3 500		3 731	0,15			
Toro European CLO DAC								
4,133 % éch. 15/02/2034		10 300		10 937	0,44			
				182 060	7,25			
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX								
European Loan Conduit DAC								
4,358 % éch. 17/02/2030		2 389		2 552	0,10			
Glenbeigh Issuer DAC								
4,350 % éch. 24/06/2050		12 205		13 253	0,53			
Primrose Residential DAC								
4,189 % éch. 24/03/2061		7 223		7 826	0,31			
Shamrock Residential DAC								
4,289 % éch. 24/12/2059		4 514		4 877	0,19			
4,689 % éch. 24/02/2071		6 844		7 424	0,30			
				35 932	1,43			
Total Irlande				217 992	8,68			

Tableau des investissements Fonds Global Real Return 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 billet du gouvernement australien à 3 ans septembre	Court	09/2023	205	\$ 84	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Long	09/2023	43	(18)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	811	1 494	0,06
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	180	(198)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	36	36	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Long	09/2023	203	(280)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Long	09/2023	102	101	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Long	09/2023	261	(27)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	3 063	2 718	0,11
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	48	(174)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Court	09/2023	129	285	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	865	1 029	0,04
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	1 481	2 891	0,12
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	442	553	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Court	09/2023	42	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	147	(290)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	339	44	0,00
				<u>\$ 8 249</u>	<u>0,33</u>

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 113,000	21/07/2023	388	\$ (274)	\$ (432)	(0,02)
					<u>\$ 7 817</u>	<u>0,31</u>

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 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
General Electric Co.	1,000 %	20/12/2023	\$ 800	\$ 47	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 ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250 %	20/09/2053	£ 4 800	\$ (434)	(0,02)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2029	¥ 10 717 000	(771)	(0,03)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,435	20/06/2029	3 683 000	(181)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,840	21/11/2028	\$ 19 700	1 880	0,07
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,880	25/01/2052	13 400	(3 758)	(0,15)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,888	21/11/2053	7 400	(2 090)	(0,08)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,865	13/02/2054	32 200	692	0,03
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,085	13/02/2034	82 600	(1 486)	(0,06)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	20/12/2053	9 000	(13)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,400	23/02/2033	5 300	(78)	0,00
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2033	16 700	(132)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,250	20/12/2025	134 900	809	0,03
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/07/2023	13 400	(53)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€ 6 500	(291)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	68 400	(663)	(0,03)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	47 600	113	0,00
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	119 200	121	0,00
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	150 500	(80)	0,00
À recevoir	CPTFEMU	1,710	15/03/2033	5 900	1 675	0,07
À recevoir	CPTFEMU	2,359	15/08/2030	25 700	1 119	0,04
À recevoir	CPTFEMU	2,470	15/07/2032	12 900	625	0,02
À payer	CPTFEMU	2,570	15/06/2032	1 300	1	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,600	15/05/2032	20 300	950	0,04
À payer	CPTFEMU	2,680	15/04/2053	6 400	(94)	0,00
À payer	CPTFEMU	2,700	15/04/2053	8 500	0	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,720	15/06/2032	63 300	1 539	0,06
À recevoir	CPTFEMU	2,975	15/08/2027	17 800	246	0,01
À payer	CPTFEMU	3,520	15/09/2024	23 800	(296)	(0,01)
À payer	CPTFEMU	3,720	15/09/2024	6 400	(44)	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	3,850 %	15/09/2024	€ 27 600	\$ (172)	(0,01)
À payer	CPURNSA	1,760	04/11/2029	\$ 23 300	(3 512)	(0,14)
À payer	CPURNSA	1,883	20/11/2029	300	(42)	0,00
À payer	CPURNSA	1,954	03/06/2029	6 200	(824)	(0,03)
À payer	CPURNSA	1,998	25/07/2029	1 800	(228)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	2,311	24/02/2031	6 500	699	0,03
À recevoir	CPURNSA	2,314	26/02/2026	14 400	1 421	0,06
À payer	CPURNSA	2,364	10/05/2028	800	(69)	0,00
À payer	CPURNSA	2,370	06/06/2028	12 900	(1 118)	(0,05)
À payer	CPURNSA	2,379	09/07/2028	700	(59)	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,573	26/08/2028	2 200	136	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,645	10/09/2028	3 600	195	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,690	01/06/2026	2 300	172	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,703	25/05/2026	8 980	672	0,03
À recevoir	CPURNSA	2,768	13/05/2026	13 900	1 014	0,04
À recevoir	CPURNSA	2,813	14/05/2026	20 100	1 420	0,06
À payer	IPC Royaume-Uni	3,835	15/10/2032	£ 22 800	(1 968)	(0,08)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,140	15/10/2031	14 200	1 520	0,06
À payer	IPC Royaume-Uni	4,143	15/10/2032	22 800	(1 765)	(0,07)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,250	15/11/2031	17 860	1 962	0,08
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,300	15/01/2032	6 000	403	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,615	15/02/2027	12 300	772	0,03
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,200	15/06/2024	5 500	359	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,330	15/06/2024	11 900	737	0,03
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,290	15/03/2024	5 500	461	0,02
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,440	15/05/2024	2 200	152	0,01
À payer	IPC Royaume-Uni	6,500	15/03/2024	26 700	(2 088)	(0,08)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,600	15/05/2024	5 400	350	0,01
					\$ (94)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (47)	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.
- (3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,237 %	17/11/2023	27 000	\$ 1 676	\$ 5 924	0,24

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)	\$ (439)	(0,02)
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)	\$ (439)	(0,02)

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	3,750 %	12/09/2023	61 100	\$ (174)	\$ (70)	0,00
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,340	17/11/2023	133 200	(1 678)	(9 825)	(0,39)
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,420	21/09/2023	138 300	(787)	(591)	(0,02)
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	12/09/2023	85 400	(239)	(99)	(0,01)
						\$ (2 878)	\$ (10 585)	(0,42)	

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

Tableau des investissements Fonds Global 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	\$ 12 200	\$ (713)	\$ 711	\$ (2)	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	2 500	(5)	(23)	(28)	0,00
					\$ (718)	\$ 688	\$ (30)	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	07/2023	AUD	940	\$ 615	\$ (11)	\$ (11)	0,00	
	07/2023	\$	3 434	AUD 5 175	11	11	0,00	
	08/2023	AUD	5 175	\$ 3 437	0	(11)	0,00	
BOA	07/2023		8 748	5 707	0	(116)	(0,01)	
	07/2023	CAD	51 867	38 118	0	(1 078)	(0,04)	
	07/2023	DKK	130 252	18 809	0	(276)	(0,01)	
	07/2023	€	40 946	44 049	0	(624)	(0,03)	
	07/2023	NZD	17 742	10 764	0	(106)	(0,01)	
	07/2023	\$	33 332	DKK 226 631	0	(125)	(0,01)	
	07/2023		5 602	£ 4 430	30	30	0,00	
	08/2023	DKK	226 252	\$ 33 332	126	126	0,01	
BPS	07/2023	¥	13 178 675	94 855	3 676	3 676	0,15	
	07/2023	\$	2 450	AUD 3 699	12	12	0,00	
	07/2023		1 475	€ 1 356	5	5	0,00	
	07/2023		7 091	£ 5 561	0	(21)	0,00	
	08/2023	AUD	3 699	\$ 2 452	0	(12)	0,00	
BRC	07/2023	NZD	418	251	0	(5)	0,00	
CBK	07/2023	AUD	3 267	2 131	0	(43)	0,00	
	07/2023	€	5 417	5 813	0	(97)	0,00	
	07/2023	£	4 190	5 259	0	(68)	0,00	
IND	07/2023	DKK	382 791	55 253	0	(835)	(0,03)	
JPM	07/2023	AUD	7 269	4 752	0	(86)	0,00	
	07/2023	NZD	4 075	2 513	16	16	0,00	
	07/2023	\$	3 021	DKK 20 815	28	28	0,00	
	07/2023		755 430	€ 691 849	0	(622)	(0,03)	
	07/2023		641 676	£ 507 494	3 527	3 527	0,14	
	07/2023		31 382	¥ 4 487 945	0	(331)	(0,01)	
	07/2023		42 427	NZD 69 621	226	226	0,01	
	08/2023	€	691 849	\$ 756 486	645	645	0,02	
	08/2023	£	507 494	641 812	0	(3 520)	(0,14)	
	08/2023	¥	4 468 874	31 382	332	332	0,01	
	08/2023	NZD	69 621	42 424	0	(225)	(0,01)	
	09/2023	PEN	8 962	2 434	0	(24)	0,00	
MBC	07/2023	€	9 704	10 499	0	(88)	0,00	
	07/2023	SEK	3 780	351	1	1	0,00	
	07/2023	\$	16 916	€ 15 739	262	255	0,01	
	07/2023		37 839	£ 30 364	764	764	0,03	
MYI	07/2023	£	548 131	\$ 681 252	0	(15 616)	(0,62)	
	07/2023	NZD	1 178	713	0	(9)	0,00	
	07/2023	SEK	291 863	27 189	168	168	0,01	
	07/2023	\$	29 630	DKK 202 115	0	(15)	0,00	
	07/2023		1 412	€ 1 296	2	2	0,00	
	07/2023		11 728	£ 9 373	189	189	0,01	
	07/2023		27 554	SEK 297 493	0	(12)	0,00	
	08/2023	DKK	201 778	\$ 29 630	16	16	0,00	
SCX	08/2023	SEK	297 124	27 554	12	12	0,00	
	07/2023	AUD	10 261	6 705	0	(125)	(0,01)	
	07/2023	NZD	46 208	28 055	0	(254)	(0,01)	
	07/2023	SEK	1 389	128	0	0	0,00	
	07/2023	\$	5 046	AUD 7 601	14	14	0,00	
	08/2023	AUD	7 601	\$ 5 050	0	(14)	0,00	
SOG	07/2023		6 212	4 064	0	(71)	0,00	
	07/2023	€	652 877	702 325	0	(9 963)	(0,40)	
TOR	07/2023	AUD	3 287	2 150	0	(38)	0,00	
	07/2023	\$	6 178	AUD 9 354	48	48	0,00	
	07/2023		39 201	CAD 51 871	27	(2)	0,00	
	07/2023		60 348	¥ 8 690 127	0	(223)	(0,01)	
	08/2023	AUD	9 354	\$ 6 183	0	(48)	0,00	
	08/2023	CAD	51 850	39 201	28	(1)	0,00	
	08/2023	¥	8 653 272	60 348	225	225	0,01	
UAG	07/2023	AUD	752	493	0	(8)	0,00	
	07/2023	\$	9 954	AUD 14 908	21	(31)	0,00	
	08/2023	AUD	14 908	\$ 9 962	52	31	0,00	
					\$ 10 463	\$ (34 856)	\$ (24 393)	(0,97)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$ 8	CHF 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07/2023	CHF 29 237	\$ 32 691	11	0	11	0,00
	07/2023	\$ 44 078	CHF 39 879	497	0	497	0,02
	08/2023	32 691	29 154	0	(11)	(11)	0,00
IND	07/2023	CHF 15 453	\$ 17 203	0	(69)	(69)	0,00
	08/2023	\$ 17 203	CHF 15 409	69	0	69	0,00
JPM	07/2023	657	594	7	0	7	0,00
MBC	07/2023	CHF 19	\$ 21	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 118	CHF 106	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	CHF 1 713	\$ 1 892	0	(22)	(22)	0,00
RBC	07/2023	\$ 8	CHF 7	0	0	0	0,00
RYL	07/2023	4	3	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	31 135	27 976	136	0	136	0,01
UAG	07/2023	CHF 30 223	\$ 33 716	0	(67)	(67)	0,00
	07/2023	\$ 27 989	CHF 25 149	122	0	122	0,00
	08/2023	33 716	30 137	66	0	66	0,00
				\$ 908	\$ (169)	\$ 739	0,03

Au 30 juin 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
AZD	07/2023	AUD 116	\$ 77	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 34	AUD 53	1	0	1	0,00
	08/2023	77	116	0	0	0	0,00
BOA	07/2023	DKK 212	\$ 31	0	0	0	0,00
	07/2023	¥ 70	1	0	0	0	0,00
	07/2023	SEK 3 055	283	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 43	AUD 66	1	0	1	0,00
	07/2023	828	CAD 1 127	23	0	23	0,00
	07/2023	17	DKK 117	0	0	0	0,00
	07/2023	68	NZD 111	1	0	1	0,00
	07/2023	2	SEK 21	0	0	0	0,00
	08/2023	31	DKK 212	0	0	0	0,00
BPS	08/2023	283	SEK 3 051	0	0	0	0,00
	07/2023	AUD 83	\$ 55	0	0	0	0,00
	07/2023	€ 8 688	9 519	41	0	41	0,00
	07/2023	\$ 0	DKK 0	0	0	0	0,00
	07/2023	1 266	¥ 175 905	0	(48)	(48)	(0,01)
	07/2023	2	NZD 3	0	0	0	0,00
	08/2023	55	AUD 83	0	0	0	0,00
	08/2023	9 532	€ 8 688	0	(41)	(41)	0,00
CBK	07/2023	144	134	2	0	2	0,00
IND	07/2023	50	DKK 343	1	0	1	0,00
JPM	07/2023	¥ 59 880	\$ 419	4	0	4	0,00
	08/2023	\$ 419	¥ 59 626	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07/2023	CAD 68	\$ 50	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	£ 514	640	0	(13)	(13)	0,00
	07/2023	\$ 10 211	£ 8 249	276	0	276	0,02
	07/2023	4	SEK 39	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	DKK 189	\$ 28	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 4	NZD 7	0	0	0	0,00
	07/2023	279	SEK 2 992	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	28	DKK 189	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	AUD 170	\$ 113	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 176	NZD 290	2	0	2	0,00
	08/2023	113	AUD 170	0	0	0	0,00
SOG	07/2023	227	347	4	0	4	0,00
	07/2023	9 202	€ 8 554	131	0	131	0,01
TOR	07/2023	AUD 209	\$ 138	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	CAD 750	565	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	£ 7 736	9 830	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	NZD 412	251	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$ 120	AUD 184	2	0	2	0,00
	08/2023	138	209	1	0	1	0,00
	08/2023	565	CAD 750	2	0	2	0,00
	08/2023	9 832	£ 7 736	5	0	5	0,00
	08/2023	251	NZD 412	1	0	1	0,00
UAG	07/2023	AUD 114	\$ 75	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 28	AUD 42	0	0	0	0,00
	08/2023	75	114	0	0	0	0,00
				\$ 498	\$ (119)	\$ 379	0,02

Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 5 432	\$ 5 924	\$ 8	\$ (10)	\$ (2)	0,00
	07/2023	\$ 401 643	€ 373 724	6 089	0	6 089	0,23
BPS	07/2023	€ 375 124	\$ 411 005	1 748	(3)	1 745	0,07
	07/2023	\$ 401 431	€ 373 420	5 971	(1)	5 970	0,24
CBK	08/2023	407 371	371 269	0	(1 762)	(1 762)	(0,07)
	07/2023	€ 393 961	\$ 427 971	7	(1 846)	(1 839)	(0,07)
JPM	08/2023	\$ 395 113	€ 362 910	1 365	0	1 365	0,05
	07/2023	€ 370 713	\$ 404 781	334	0	334	0,01
MBC	07/2023	\$ 32 087	€ 30 011	655	0	655	0,02
	08/2023	405 347	370 713	0	(346)	(346)	(0,01)
SOG	07/2023	€ 7 537	\$ 8 124	5	(104)	(99)	0,00
	07/2023	\$ 207	€ 194	4	0	4	0,00
	07/2023	401 628	373 351	5 698	0	5 698	0,23
				\$ 21 884	\$ (4 072)	\$ 17 812	0,70

Au 30 juin 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	07/2023	£ 705	\$ 887	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	0,00
	07/2023	\$ 571	£ 706	0	(20)	(20)	0,00
BPS	07/2023	\$ 110 483	£ 89 321	3 076	(1)	3 075	0,12
	07/2023	£ 503	\$ 630	0	(10)	(10)	0,00
CBK	07/2023	1 149	1 451	0	(10)	(10)	0,00
	07/2023	\$ 2 360	£ 1 849	1	(10)	(9)	0,00
JPM	07/2023	£ 89 037	\$ 112 579	0	(619)	(619)	(0,02)
	08/2023	\$ 112 603	£ 89 037	618	0	618	0,02
MBC	07/2023	111 239	89 852	2 995	(1)	2 994	0,11
	07/2023	£ 81	\$ 100	0	(3)	(3)	0,00
MYI	07/2023	\$ 110 059	£ 88 553	2 523	0	2 523	0,10
	07/2023	£ 89 242	\$ 113 400	0	(58)	(58)	0,00
TOR	07/2023	\$ 113 425	£ 89 242	56	0	56	0,00
				\$ 9 269	\$ (741)	\$ 8 528	0,33

Au 30 juin 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
BRC	07/2023	\$ 58 438	SGD 79 073	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
GLM	07/2023	SGD 6 452	\$ 4 807	40	0	40	0,00
	07/2023	\$ 1 185	SGD 1 597	0	(6)	(6)	0,00
JPM	07/2023	SGD 77 974	\$ 57 622	6	0	6	0,00
	07/2023	\$ 9 900	SGD 13 399	1	0	1	0,00
MBC	08/2023	57 622	77 899	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	53 127	71 780	0	(88)	(88)	0,00
MYI	07/2023	SGD 75 541	\$ 55 906	89	0	89	0,00
	08/2023	\$ 55 906	SGD 75 472	0	(84)	(84)	0,00
UAG	07/2023	57 315	77 535	0	(24)	(24)	0,00
				\$ 136	\$ (217)	\$ (81)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (2 146) (0,09)

Total des Investissements

\$ 3 419 634 136,20

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (908 965) (36,20)

Actifs nets

\$ 2 510 669 100,00

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 montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(c) Affilié au Fonds.

(d) Des titres d'une juste valeur globale de 791 485 \$ (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 30 juin 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 30 juin 2023.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 101 \$) 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 30 047 \$ (31 décembre 2022 : 24 192 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 17 910 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 3 401 573	\$ 4	\$ 3 401 577
Fonds d'investissement	10 161	0	0	10 161
Contrats de mise en pension	0	2 272	0	2 272
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	3 780	1 844	0	5 624
Totaux	\$ 13 941	\$ 3 405 689	\$ 4	\$ 3 419 634

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.

Contrats de prise en pension au 30 juin 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	5,180 %	14/06/2023	05/07/2023	\$ (10 841)	\$ (10 867)	(0,43)
BSN	5,180	04/05/2023	06/07/2023	(544 125)	(548 666)	(21,85)
CIB	5,170	15/06/2023	27/07/2023	(19 174)	(19 218)	(0,77)
GRE	5,170	20/06/2023	06/07/2023	(34 190)	(34 244)	(1,37)
NOM	5,200	17/05/2023	17/07/2023	(177 163)	(178 315)	(7,10)
Total des Contrats de prise en pension					\$ (791 310)	(31,52)

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ (10)	\$ 0	\$ (10)	\$ S/O	\$ S/O	\$ S/O
BOA	3 934	(2 880)	1 054	3 056	(2 990)	66
BOM	S/O	S/O	S/O	110	0	110
BPS	13 047	(11 300)	1 747	(381)	580	199
BRC	(25)	0	(25)	(156)	130	(26)
CBK	(699)	630	(69)	11 029	(10 872)	157
DUB	(3 901)	3 710	(191)	(3 859)	3 720	(139)
FAR	(591)	810	219	S/O	S/O	S/O
GLM	(405)	270	(135)	(1 194)	610	(584)
GST	(2)	0	(2)	(2 425)	2 410	(15)
IND	(834)	850	16	S/O	S/O	S/O
JPM	518	(530)	(12)	(2 608)	2 180	(428)
MBC	4 005	(2 910)	1 095	8 954	(8 240)	714
MYC	S/O	S/O	S/O	(36)	90	54
MYI	(12 764)	8 350	(4 414)	(3 890)	2 910	(980)
RBC	S/O	S/O	S/O	44	0	44
SAL	(28)	130	102	(20)	130	110
SCX	(241)	60	(181)	(7 751)	7 310	(441)
SOG	(4 201)	3 100	(1 101)	S/O	S/O	S/O
TOR	(38)	0	(38)	(270)	1 420	1 150
UAG	89	0	89	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	118,68	115,82
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	16,79	15,81
Autres valeurs mobilières	0,02	0,25
Fonds d'investissement	0,40	0,27
Contrats de mise en pension	0,09	0,09
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,31	(0,09)
Instruments financiers dérivés compensés	0,00	0,58
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,09)	0,02
Contrats de prise en pension	(31,52)	(30,96)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	S/O	(0,37)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	1,08	1,83
Belgique	0,07	0,07
Canada	1,50	1,46
Îles Caïmans	1,39	1,58
Danemark	2,89	4,20
France	8,98	7,82
Allemagne	0,94	0,86
Irlande	8,68	8,54
Italie	9,09	7,79
Japon	4,12	4,27
Luxembourg	S/O	0,02
Pays-Bas	0,69	0,71
Nouvelle-Zélande	1,68	1,63
Pérou	0,01	0,07
Slovénie	0,04	0,04
Espagne	1,84	1,71
Suède	1,14	1,15
Suisse	0,16	S/O
Royaume-Uni	25,38	25,93
États-Unis	65,55	62,20
Instruments à court terme	0,26	S/O
Fonds d'investissement	0,40	0,27
Contrats de mise en pension	0,09	0,09
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,33	(0,09)
Options vendues		
Options sur 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	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,00	0,58
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,24	0,46
Options vendues		
Options plafonnées sur l'inflation	(0,02)	(0,02)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,42)	(0,88)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,00
Contrats de change à terme	(0,97)	(0,96)
Contrats de change à terme couverts	1,08	1,42
Autres actifs et passifs à court terme	(36,20)	(32,75)
Actifs nets	100,00	100,00

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	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR L'ACTIF (en milliers)	EN % DE NET
5,875 % éch. 01/10/2028	\$ 900		0,00	4,810 % éch. 17/09/2030	43 097		0,06	Venture Global Calcasieu Pass LLC	\$ 38 600	\$ 33 756	0,05
10,250 % éch. 01/05/2030	204 910	161 672	0,25	NMG Holding Co., Inc.	\$ 92 700	\$ 86 384	0,13	3,875 % éch. 15/08/2029	164 200	134 680	0,21
CDW LLC				7,125 % éch. 01/04/2026				4,125 % éch. 15/08/2031	37 800	32 560	0,05
2,670 % éch. 01/12/2026	7 600	6 833	0,01	Noble Finance LLC	7 084	7 209	0,01	Venture Global LNG, Inc.	69 158	70 317	0,11
3,569 % éch. 01/12/2031	26 300	22 230	0,04	8,000 % éch. 15/04/2030				8,125 % éch. 01/06/2028	69 158	69 816	0,11
Cellnex Finance Co. S.A.				Norfolk Southern Corp.	4 300	3 040	0,01	8,375 % éch. 01/06/2031			
3,875 % éch. 07/07/2041	10 300	7 556	0,01	NPC Ukrenargo				Veritas U.S., Inc.	4 090	3 324	0,01
Charter Communications Operating LLC				6,875 % éch. 09/11/2028 ^	1 000	215	0,00	7,500 % éch. 01/09/2025			
3,850 % éch. 01/04/2061	11 200	6 784	0,01	Oracle Corp.				Viking Cruises Ltd.	31 212	32 794	0,05
3,900 % éch. 01/06/2052	110 300	72 277	0,11	3,850 % éch. 01/04/2060	23 840	16 817	0,03	13,000 % éch. 15/05/2025			
3,950 % éch. 30/06/2062	26 400	16 265	0,03	3,950 % éch. 25/03/2051 (m)	16 970	12 841	0,02	Weir Group PLC	9 000	8 066	0,01
4,400 % éch. 01/12/2061	44 400	30 009	0,05	4,100 % éch. 25/03/2061 (m)	25 100	18 545	0,03	2,200 % éch. 13/05/2026			
Community Health Systems, Inc.				PeaceHealth Obligated Group	13 300	8 987	0,01	Wesco Aircraft Holdings, Inc. (7,500 % en numéraire et 3,000 % de rémunération en nature)			
5,625 % éch. 15/03/2027	161 300	142 299	0,22	3,218 % éch. 15/11/2050				10,500 % éch.	30 072	27 366	0,04
8,000 % éch. 15/03/2026	102 191	99 637	0,15	Petroleos de Venezuela S.A.	53 114	1 875	0,00	15/11/2026 ^ (d)			
Constellation Oil Services Holding S.A.	1 250	1 233	0,00	5,375 % éch. 12/04/2027 ^	50 574	1 960	0,00	Wesleyan University	2 100	1 781	0,00
13,500 % éch. 30/06/2025	2 964	1 754	0,00	5,500 % éch. 12/04/2037 ^	47 576	1 844	0,00	4,781 % éch. 01/07/2116			
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)				6,000 % éch. 16/05/2024 ^	63 177	2 195	0,00	Windstream Escrow LLC	73 300	60 911	0,09
3,000 % éch. 31/12/2026 (d)				6,000 % éch. 15/11/2026 ^	28 330	1 112	0,00	7,750 % éch. 15/08/2028			
CoStar Group, Inc.	11 362	9 385	0,02	9,750 % éch. 17/05/2035 ^				Wynn Macau Ltd.	14 700	13 670	0,02
2,800 % éch. 15/07/2030				Petroleos Mexicanos	€ 3 900	3 385	0,01	5,500 % éch. 15/01/2026			
CVS Pass-Through Trust				2,750 % éch. 21/04/2027	\$ 43 161	31 564	0,05				
4,163 % éch. 11/08/2036	1 407	1 215	0,00	5,950 % éch. 28/01/2031	303 442	230 991	0,36	SERVICES AUX COLLECTIVITÉS			
4,704 % éch. 10/01/2036	5 264	4 863	0,01	6,700 % éch. 16/02/2032	2 466	1 551	0,00	Enel Finance America LLC	3 200	3 365	0,01
5,926 % éch. 10/01/2034	741	704	0,00	6,750 % éch. 21/09/2047	60 850	38 001	0,06	7,100 % éch. 14/10/2027			
6,036 % éch. 10/12/2028	2 551	2 531	0,00	6,950 % éch. 28/01/2060	9 240	6 271	0,01	Enel Finance International NV	1 700	1 886	0,00
6,943 % éch. 10/01/2030	5 141	5 241	0,01	7,690 % éch. 23/01/2050				7,500 % éch. 14/10/2032			
7,507 % éch. 10/01/2032	5 931	6 190	0,01	Prime Healthcare Services, Inc.	7 250	€ 35 984	0,05	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC	183 800	114 875	0,18
8,353 % éch. 10/07/2031	4 658	5 016	0,01	7,250 % éch. 01/11/2025				2,950 % éch. 27/01/2029			
DISH DBS Corp.				Prosus NV	€ 10 500	7 880	0,01	Pacific Gas & Electric Co.	46 400	45 611	0,07
5,250 % éch. 01/12/2026	72 570	58 350	0,09	1,985 % éch. 13/07/2033	3 900	3 335	0,01	1,700 % éch. 15/11/2023			
5,750 % éch. 01/12/2028	81 200	60 547	0,09	2,085 % éch. 19/01/2030	8 700	7 005	0,01	2,100 % éch. 01/08/2027	7 177	6 136	0,01
Energy Transfer LP	2 500	2 421	0,00	2,778 % éch. 19/01/2034	\$ 4 600	3 598	0,01	2,500 % éch. 01/02/2031	12 391	9 710	0,02
4,950 % éch. 15/05/2028				3,061 % éch. 13/07/2031	3 700	3 118	0,01	2,500 % éch. 15/06/2028	104 155	95 462	0,15
Exela Intermediate LLC	5 923	563	0,00	4,193 % éch. 19/01/2032				3,000 % éch. 01/03/2026 ^	31 800	27 440	0,04
11,500 % éch. 15/07/2026				RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.	2 700	2 268	0,00	3,150 % éch. 01/01/2026	60 363	56 042	0,09
Ford Foundation	7 900	4 891	0,01	9,750 % éch. 08/12/2026				3,250 % éch. 16/02/2024	66 100	64 895	0,10
2,815 % éch. 01/06/2070				Roadster Finance DAC	€ 7 000	6 295	0,01	3,250 % éch. 01/06/2031	37 030	30 143	0,05
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.	€ 500	450	0,00	2,375 % éch. 08/12/2032				3,300 % éch. 15/03/2027 ^	19 465	17 683	0,03
2,250 % éch. 22/11/2024	56 890	52 447	0,08	Rolls-Royce PLC	17 996	19 349	0,03	3,300 % éch. 01/12/2027 ^	106 702	93 636	0,15
2,949 % éch. 24/01/2024	€ 500	562	0,00	4,625 % éch. 16/02/2026	13 071	15 450	0,02	3,400 % éch. 15/08/2024 ^	52 193	50 522	0,08
4,250 % éch. 06/04/2024 ^	\$ 20 300	15 834	0,03	5,750 % éch. 15/10/2027				3,450 % éch. 01/07/2025	103 044	97 341	0,15
4,950 % éch. 23/03/2027	24 600	18 326	0,03	Royal Caribbean Cruises Ltd.	\$ 29 833	31 680	0,05	3,500 % éch. 15/06/2025 ^	63 544	60 188	0,09
4,950 % éch. 06/02/2028	32 700	26 160	0,04	11,500 % éch. 01/06/2025				3,500 % éch. 01/08/2020	12 179	7 764	0,01
5,150 % éch. 11/02/2028	18 510	15 784	0,03	Russian Railways Via RZD Capital PLC	€ 13 950	13 793	0,02	3,750 % éch. 15/02/2024 ^	29 892	29 403	0,05
7,288 % éch. 16/08/2037	29 819	26 658	0,04	7,487 % éch. 25/03/2031 ^				3,750 % éch. 01/07/2028	113 694	101 977	0,16
8,625 % éch. 28/04/2034	8 880	7 939	0,01	Sands China Ltd.	\$ 11 337	10 668	0,02	3,750 % éch. 15/08/2042 ^	20 803	14 416	0,02
8,625 % éch. 28/04/2034 ^				4,300 % éch. 08/01/2026	36 476	35 609	0,06	3,850 % éch. 15/11/2023 ^	17 368	17 218	0,03
Greene King Finance PLC	€ 3 823	3 985	0,01	5,625 % éch. 08/08/2025	26 510	25 295	0,04	3,950 % éch. 01/12/2047 ^	4 700	3 208	0,00
4,064 % éch. 15/03/2035	3 081	3 452	0,01	5,900 % éch. 08/08/2028				4,000 % éch. 01/12/2046 ^	16 783	11 274	0,02
5,106 % éch. 15/03/2034				Sprint Spectrum Co. LLC	11 644	11 496	0,02	4,200 % éch. 01/03/2029	32 300	29 057	0,04
Imperial Brands Finance Netherlands BV	€ 5 290	4 182	0,01	4,738 % éch. 20/09/2029				4,200 % éch. 01/06/2041	4 900	3 657	0,01
1,750 % éch. 18/03/2033				Sutter Health	2 900	2 194	0,00	4,250 % éch. 01/08/2023	30 771	30 740	0,05
Imperial Brands Finance PLC	\$ 3 894	3 629	0,01	3,161 % éch. 15/08/2040	19 400	13 948	0,02	4,250 % éch. 15/03/2046 ^	25 035	17 838	0,03
3,500 % éch. 26/07/2026				3,361 % éch. 15/08/2050				4,300 % éch. 15/03/2045 ^	66 234	47 365	0,07
Integrus Baptist Medical Center, Inc.	10 500	7 937	0,01	Syngenta Finance NV	4 948	4 846	0,01	4,400 % éch. 01/03/2032	33 000	28 624	0,04
3,875 % éch. 15/08/2050				4,892 % éch. 24/04/2025				4,450 % éch. 15/04/2042 ^	33 949	25 745	0,04
Intelsat Jackson Holdings S.A.	337 627	308 205	0,48	Times Square Hotel Trust	1 480	1 464	0,00	4,500 % éch. 01/07/2040	80 778	62 904	0,10
6,500 % éch. 15/03/2030				8,528 % éch. 01/08/2026				4,500 % éch. 15/12/2041 ^	4 657	3 437	0,01
JetBlue Pass-Through Trust	39 190	35 794	0,06	Topaz Solar Farms LLC	5 496	5 056	0,01	4,550 % éch. 01/07/2030	210 515	190 679	0,30
4,000 % éch. 15/05/2034				4,875 % éch. 30/09/2039	46 760	45 919	0,07	4,600 % éch. 15/06/2043 ^	41 543	31 486	0,05
Market Bidco Finco PLC	€ 103 700	91 362	0,14	5,750 % éch. 30/09/2039				4,650 % éch. 01/08/2028	4 100	3 795	0,01
4,750 % éch. 04/11/2027				U.S. Airways Pass-Through Trust	2 676	2 498	0,00	4,750 % éch. 15/02/2044 ^	31 088	24 165	0,04
Massachusetts Institute of Technology	\$ 375	350	0,00	3,950 % éch. 15/05/2027				4,950 % éch. 08/06/2025	15 300	14 838	0,02
4,678 % éch. 01/07/2114	597	675	0,00	U.S. Renal Care, Inc.	11 082	2 826	0,00	4,950 % éch. 01/07/2050	160 171	126 011	0,20
5,600 % éch. 01/07/2111				10,625 % éch. 15/07/2027				5,250 % éch. 01/03/2052	33 000	26 863	0,04
Mitchells & Butlers Finance PLC	3 984	3 668	0,01	United Airlines Pass-Through Trust	19 164	16 102	0,03	5,450 % éch. 15/06/2027	8 500	8 273	0,01
6,002 % éch. 15/12/2030	€ 5 664	6 471	0,01	2,700 % éch. 01/11/2033				5,900 % éch. 15/06/2032	10 000	9 632	0,01
6,013 % éch. 15/12/2030				3,500 % éch. 01/09/2031	784	709	0,00	Peru LNG SRL	600	483	0,00
Netflix, Inc.	€ 3 700	3 848	0,01	3,750 % éch. 03/03/2028	8 012	7 532	0,01	5,375 % éch. 22/03/2030			
3,625 % éch. 15/06/2030	35 698	38 030	0,06	4,000 % éch. 11/10/2027	506	476	0,00	Petrobras Global Finance BV	€ 9 939	11 993	0,02
3,875 % éch. 15/11/2029	13 740	15 188	0,02	4,150 % éch. 11/10/2025	333	328	0,00	6,250 % éch. 14/12/2026			
4,625 % éch. 15/05/2029				4,150 % éch. 25/02/2033	750	689	0,00	PG&E Wildfire Recovery Funding LLC	\$ 20 100	19 151	0,03
Nissan Motor Co. Ltd.	46 600	45 679	0,07	5,875 % éch. 15/04/2029	87 140	86 499	0,13	4,263 % éch. 01/06/2038	22 200	20 563	0,03
3,201 % éch. 17/09/2028	\$ 58 000	53 982	0,08	Valaris Ltd.	1 327	1 333	0,00	4,377 % éch. 03/06/2041	22 800	20 845	0,03
3,522 % éch. 17/09/2025	82 724	75 297	0,12	8,375 % éch. 30/04/2030				4,451 % éch. 01/12/2049	22 830	20 845	0,03
4,345 % éch. 17/09/2027											

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
Rio Oil Finance Trust				0,850 % éch. 25/12/2049 (a)	\$ 23 359	\$ 1 465	0,00	4,000 % éch. 01/08/2030 -			
8,200 % éch. 06/04/2028	\$ 16 055	\$ 16 155	0,02	0,957 % éch. 15/11/2042 (a)	3 511	339	0,00	01/07/2053	\$ 1 873 780	\$ 1 763 136	2,73
9,250 % éch. 06/07/2024	7 935	8 012	0,01	1,007 % éch. 15/01/2042 (a)	209	14	0,00	4,500 % éch. 01/11/2023 -			
9,750 % éch. 06/01/2027	6 935	7 161	0,01	1,111 % éch. 25/04/2029 (a)	42 809	1 502	0,00	01/08/2048	12 056	11 838	0,02
Sprint Capital Corp.				1,557 % éch. 15/03/2037 (a)	78	6	0,00	5,000 % éch. 01/05/2026 -			
8,750 % éch. 15/03/2032	12 200	14 759	0,02	2,500 % éch. 15/09/2027 (a)	4 594	176	0,00	01/04/2049	1 840	1 830	0,00
Sprint LLC				3,000 % éch. 15/12/2032 -				5,500 % éch. 01/12/2034 -			
7,125 % éch. 15/06/2024	47 819	48 290	0,07	15/04/2049 (a)	3 800	841	0,00	01/06/2053	1 604 168	1 598 495	2,48
7,625 % éch. 01/03/2026	20 490	21 303	0,03	3,000 % éch. 01/11/2046 -				6,000 % éch. 01/08/2031 -			
7,875 % éch. 15/09/2023	214 378	215 089	0,33	01/05/2049	2 147	1 928	0,00	01/05/2053	2 591 447	2 616 103	4,06
		2 049 108	3,18	3,103 % éch. 25/10/2046	5 214	4 957	0,01	6,500 % éch. 01/09/2024 -			
				3,336 % éch. 15/10/2033	389	363	0,00	01/07/2053	2 135 339	2 181 897	3,38
Total des Obligations et billets privés		11 968 348	18,55	3,500 % éch. 15/12/2032 -				7,500 % éch. 01/04/2029 -			
				15/06/2049 (a)	7 752	1 202	0,00	01/10/2030	1	0	0,00
				3,500 % éch. 01/07/2046 -				8,000 % éch. 01/03/2030	0	0	0,00
				01/07/2052	24 464	22 456	0,04	8,500 % éch. 01/04/2025	0	0	0,00
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				4,000 % éch. 01/04/2025 -				Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
Multiplan Corp. (6,000 % en numéraire ou 7,000 % de rémunération en nature)				01/11/2047	52	51	0,00	2,000 % éch. 01/07/2038	200	177	0,00
6,000 % éch. 15/10/2027 (d)	30 000	20 370	0,03	4,000 % éch. 15/06/2049 (a)	4 529	850	0,00	2,500 % éch. 01/07/2038 -			
				4,315 % éch. 25/10/2052	121 728	113 224	0,18	01/08/2053	1 350	1 226	0,00
				4,419 % éch. 25/12/2047	3 344	3 331	0,01	3,000 % éch. 01/07/2038 -			
				4,442 % éch. 25/11/2052	141 392	134 953	0,21	01/08/2053	1 711 200	1 513 442	2,35
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				4,500 % éch. 01/08/2048	8 097	7 943	0,01	3,500 % éch. 01/08/2053	3 352 284	3 058 304	4,74
Obligations Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022				4,500 % éch. 15/05/2049 (a)	3 555	675	0,00	4,000 % éch. 01/07/2053	2 260 641	2 123 502	3,29
0,000 % éch. 01/11/2043	56 528	28 547	0,05	5,000 % éch. 15/02/2049 (a)	1 616	296	0,00	4,500 % éch. 01/07/2053	2 633 100	2 532 957	3,93
Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, (ST APPROP Insured), Series 2021				5,500 % éch. 01/08/2033 -				5,000 % éch. 01/07/2053	2 881 400	2 823 953	4,38
3,000 % éch. 01/06/2046	3 000	2 765	0,01	01/04/2036	0	0	0,00	5,500 % éch. 01/07/2053	3 046 803	3 031 876	4,70
Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021				6,000 % éch. 01/01/2033	0	0	0,00	6,000 % éch. 01/07/2053	4 004 120	4 038 828	6,26
3,850 % éch. 01/06/2050	2 255	2 047	0,00	6,500 % éch. 01/02/2032 -				6,500 % éch. 01/07/2053	948 090	967 937	1,50
4,214 % éch. 01/06/2050	13 300	9 977	0,02	25/11/2049	2 927	3 123	0,01				
Obligations Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				7,000 % éch. 01/12/2025 -							
6,630 % éch. 01/02/2035	7 334	7 661	0,01	01/06/2037	6	2	0,00				
6,725 % éch. 01/04/2035	2 488	2 615	0,00	8,000 % éch. 01/07/2030	0	0	0,00				
7,350 % éch. 01/07/2035	7 447	8 034	0,01	Ginnie Mae							
Obligations Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, (GTD STD LNS Insured), Series 2006				0,000 % éch. 20/12/2040	1 824	1 505	0,00	OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
5,385 % éch. 25/10/2036	5 821	5 788	0,01	0,000 % éch. 20/01/2049 (a)	47 947	702	0,00	Obligations du Trésor américain			
Obligations Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				0,152 % éch. 18/05/2050 (a)	795	2	0,00	2,500 % éch. 15/02/2045	59 000	45 710	0,07
6,050 % éch. 01/07/2032 ^	6 790	2 563	0,00	0,992 % éch. 18/01/2043 (a)	638	37	0,00	2,875 % éch. 15/05/2043	69 079	57 824	0,09
6,125 % éch. 01/07/2040 ^	435	164	0,00	2,500 % éch. 20/04/2025	61 083	52 951	0,08	2,875 % éch. 15/08/2045	510 010	421 177	0,65
Obligations Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, Series 2008				2,625 % éch. 20/07/2042	9 416	8 999	0,01	3,000 % éch. 15/11/2044	371 252	314 382	0,49
5,375 % éch. 01/07/2022 ^	2 355	883	0,00	3,500 % éch. 20/03/2043 (a)	685	106	0,00	3,000 % éch. 15/08/2048	81 815	69 078	0,11
Obligations University of California Revenue Bonds, Series 2012				3,500 % éch. 20/07/2052 -				3,000 % éch. 15/02/2049	10 169	8 606	0,01
4,858 % éch. 15/05/2112	12 280	10 948	0,02	20/02/2053	449	416	0,00	3,125 % éch. 15/02/2043	178 076	155 399	0,24
		81 992	0,13	3,575 % éch. 20/07/2067	13 883	13 887	0,02	3,125 % éch. 15/08/2044	283 117	245 140	0,38
				4,335 % éch. 20/08/2066	15	15	0,00	3,125 % éch. 15/05/2048	55 840	48 207	0,08
				4,508 % éch. 20/09/2067	12 061	12 052	0,02	3,375 % éch. 15/05/2044	416 095	375 363	0,58
				5,099 % éch. 20/09/2066	18 111	18 430	0,03	3,625 % éch. 15/02/2044	145 436	136 341	0,21
				5,120 % éch. 20/07/2065	12 880	12 836	0,02	3,750 % éch. 15/11/2043	80 988	77 446	0,12
				5,263 % éch. 20/04/2037	7	7	0,00	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (h)			
				5,283 % éch. 20/06/2067	3 365	3 353	0,01	0,125 % éch. 15/07/2024	1 165 567	1 130 738	1,75
				5,394 % éch. 20/09/2066	8 407	8 508	0,01	0,125 % éch. 15/10/2024	731 794	705 934	1,09
				5,431 % éch. 20/06/2067	13 480	13 464	0,02	0,125 % éch. 15/02/2025	166 598	158 508	0,25
				5,452 % éch. 20/08/2066	2 651	2 644	0,00	0,125 % éch. 15/07/2030	304 705	273 383	0,42
				5,616 % éch. 20/06/2067	6 667	6 659	0,01	0,125 % éch. 15/01/2031	11 186	9 946	0,02
				5,684 % éch. 20/04/2062	400	398	0,00	0,125 % éch. 15/07/2031	45 301	40 192	0,06
				5,694 % éch. 20/01/2062	16	16	0,00	0,250 % éch. 15/01/2025	394 198	377 936	0,59
				5,711 % éch. 20/07/2066	2 213	2 202	0,00	0,250 % éch. 15/07/2029	871 905	796 478	1,24
				5,894 % éch. 20/06/2066	7 653	7 616	0,01	0,250 % éch. 15/02/2050	114 556	80 223	0,12
				6,000 % éch. 15/04/2037 -				0,375 % éch. 15/07/2023	545 986	545 604	0,85
				20/11/2038	0	0	0,00	0,375 % éch. 15/01/2027	19 112	17 937	0,03
				6,500 % éch. 15/12/2023 -				0,375 % éch. 15/07/2027 (n)	5 158	4 837	0,01
				15/09/2037	4	4	0,00	0,500 % éch. 15/04/2024	537 186	524 227	0,81
				7,000 % éch. 20/08/2023 -				0,625 % éch. 15/01/2024	939 998	924 111	1,43
				15/05/2038	3	1	0,00	0,625 % éch. 15/07/2032	507 768	466 978	0,72
				7,500 % éch. 15/09/2023 -				0,625 % éch. 15/02/2043	15 963	13 109	0,02
				20/01/2030	0	0	0,00	0,750 % éch. 15/07/2028	170 180	161 321	0,25
				8,000 % éch. 15/07/2024 -				0,750 % éch. 15/02/2042	45 236	38 474	0,06
				15/05/2032	1	0	0,00	0,750 % éch. 15/02/2045	150 277	124 326	0,19
				8,500 % éch. 15/01/2031	0	0	0,00	0,875 % éch. 15/01/2029	204 555	193 696	0,30
				Ginnie Mae, TBA				0,875 % éch. 15/02/2047	116 227	97 624	0,15
				2,500 % éch. 01/07/2053	33 900	29 361	0,05	1,000 % éch. 15/02/2046	62 341	54 139	0,08
				3,500 % éch. 01/07/2053	620 000	572 954	0,89	1,000 % éch. 15/02/2048	138 128	118 950	0,18
				4,000 % éch. 01/08/2053	136 800	129 549	0,20	1,000 % éch. 15/02/2049	363 320	312 808	0,49
				4,500 % éch. 01/07/2053	161 700	156 125	0,24	1,375 % éch. 15/02/2044	17 439	16 443	0,03
				5,000 % éch. 01/08/2053	228 500	224 483	0,35	2,125 % éch. 15/02/2040	23 014	24 713	0,04
				Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				2,125 % éch. 15/02/2041	10 388	11 156	0,02
				01/03/2032	296	275	0,00	Billets du Trésor américain			
				3,000 % éch. 01/02/2025 -				0,375 % éch. 30/09/2027	38 660	32 910	0,05
				01/12/2052	2 513 437	2 219 914	3,44	0,500 % éch. 31/10/2027	46 600	39 785	0,06
				3,500 % éch. 01/11/2025 -				0,625 % éch. 30/11/2027	542 910	465 089	0,72
				01/07/2053	1 326 261	1 212 447	1,88	0,625 % éch. 31/12/2027	230 260	196 805	0,31
								0,750 % éch. 31/01/2028	199 210	170 920	0,27
								1,500 % éch. 15/08/2026	56 200	51 381	0,08
								2,000 % éch. 15/02/2025	15 000	14 281	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
5,870 % éch. 25/08/2035	\$ 4 782	\$ 4 458	0,01	ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates				5,750 % éch. 25/04/2037	\$ 3 722	\$ 3 349	0,01
6,125 % éch. 25/07/2035	1 500	1 357	0,00	Trust				5,800 % éch. 25/12/2036	1 676	1 349	0,00
6,275 % éch. 25/01/2035	1 666	1 539	0,00	4,042 % éch. 25/08/2037 ^	\$ 600	\$ 508	0,00	6,000 % éch. 25/07/2036	925	800	0,00
6,800 % éch. 25/09/2034	1 111	1 068	0,00	5,610 % éch. 25/08/2037 ^	5 538	5 083	0,01	6,000 % éch. 25/09/2036	197	171	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				Chester A PLC				6,000 % éch. 25/10/2036 ^	206	177	0,00
5,125 % éch. 25/03/2034	342	351	0,00	0,000 % éch. 17/03/2046				6,000 % éch. 25/11/2036	3 301	2 947	0,01
5,500 % éch. 25/08/2035	1 778	1 093	0,00	(f)(m)	£ 13 675	15 221	0,02	6,000 % éch. 25/05/2037 ^	423	365	0,00
5,500 % éch. 25/09/2035	162	138	0,00	0,000 % éch. 20/05/2046 (m)	1	5 711	0,01	6,000 % éch. 25/06/2037	6 526	5 639	0,01
5,500 % éch. 25/12/2035 ^	2 884	1 461	0,00	5,702 % éch. 17/03/2046 (m)	51 712	65 956	0,10	Commercial Mortgage Trust			
5,550 % éch. 25/10/2034	56	47	0,00	6,152 % éch. 17/03/2046 (m)	14 727	18 645	0,03	0,250 % éch. 10/04/2047 (a)	58 900	53	0,00
5,750 % éch. 25/11/2034 ^	1 531	1 315	0,00	6,652 % éch. 17/03/2046 (m)	13 675	17 191	0,03	1,108 % éch. 10/08/2046 (a)	6 232	0	0,00
6,500 % éch. 25/03/2037	1 471	1 248	0,00	7,152 % éch. 17/03/2046 (m)	8 415	10 491	0,02	1,450 % éch. 10/10/2049 (a)	66 785	2 052	0,00
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				7,902 % éch. 17/03/2046 (m)	4 207	5 163	0,01	3,140 % éch. 10/10/2036	10 000	8 730	0,01
5,290 % éch. 25/03/2037	2 385	2 057	0,00	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				3,178 % éch. 10/02/2035	29 775	27 663	0,04
5,310 % éch. 25/12/2046	2 942	2 416	0,00	5,037 % éch. 25/08/2035	\$ 725	564	0,00	3,505 % éch. 10/08/2048	7 213	6 853	0,01
5,310 % éch. 25/06/2047	2 750	2 314	0,00	5,300 % éch. 25/01/2036	246	217	0,00	3,651 % éch. 10/02/2049	13 901	13 155	0,02
5,320 % éch. 25/06/2047	6 610	5 581	0,01	5,330 % éch. 25/05/2036	738	659	0,00	3,732 % éch. 10/08/2049	13 175	12 317	0,02
5,330 % éch. 25/10/2036	960	814	0,00	5,350 % éch. 25/01/2036	671	603	0,00	3,961 % éch. 10/05/2051	39 998	37 148	0,06
5,340 % éch. 25/01/2037	10 128	9 198	0,02	5,380 % éch. 25/10/2035	705	653	0,00	6,293 % éch. 15/09/2033	10 849	9 954	0,02
5,550 % éch. 25/02/2037 ^	8 959	8 084	0,01	5,400 % éch. 25/08/2035	710	663	0,00	Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust			
5,550 % éch. 25/09/2047	11 038	10 033	0,02	5,420 % éch. 25/05/2035	581	552	0,00	6,000 % éch. 25/05/2036 ^	282	168	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				5,430 % éch. 25/01/2035	327	309	0,00	6,250 % éch. 25/08/2037	1 203	636	0,00
3,484 % éch. 26/12/2046 ^	1 822	1 375	0,00	5,450 % éch. 25/08/2035	118	108	0,00	7,000 % éch. 25/01/2037 ^	287	62	0,00
4,098 % éch. 26/01/2036 ^	1 530	1 226	0,00	5,470 % éch. 25/05/2035	160	149	0,00	Countrywide Alternative Loan Trust			
BellaVista Mortgage Trust				5,510 % éch. 25/03/2035	155	149	0,00	1,350 % éch. 25/02/2037 (a)	831	119	0,00
5,874 % éch. 22/01/2045	480	411	0,00	5,730 % éch. 25/10/2035	336	304	0,00	1,800 % éch. 25/10/2037	1 577	285	0,00
BNPP Mortgage Securities LLC Trust				5,830 % éch. 25/10/2034	398	368	0,00	^(a)			
6,000 % éch. 27/08/2037	1 143	398	0,00	Citigroup Commercial Mortgage Trust				3,324 % éch. 25/05/2035 ^	1 997	1 477	0,00
Braemar Hotels & Resorts Trust				0,452 % éch. 11/03/2047 (a)	25 416	34	0,00	3,369 % éch. 25/10/2035 ^	165	142	0,00
6,138 % éch. 15/06/2035	262	260	0,00	3,635 % éch. 10/05/2035	7 410	6 445	0,01	3,716 % éch. 25/07/2021 ^	4	3	0,00
Brants Bridge PLC				6,468 % éch. 15/12/2036	4 150	4 076	0,01	4,003 % éch. 25/09/2034 ^	1 124	1 059	0,00
0,000 % éch. 14/06/2066 (c)	£ 22 000	27 836	0,04	7,118 % éch. 15/12/2036	6 675	6 416	0,01	4,008 % éch. 25/06/2037 ^	7 356	6 236	0,01
Bridgegate Funding PLC				8,118 % éch. 15/12/2036	4 000	3 826	0,01	4,024 % éch. 25/03/2047 ^	884	796	0,00
6,718 % éch. 16/10/2062	62 868	79 837	0,12	Citigroup Mortgage Loan Trust				4,047 % éch. 25/03/2047	701	607	0,00
7,466 % éch. 16/10/2062	44 065	55 332	0,09	3,126 % éch. 25/02/2037	3 198	2 362	0,00	4,048 % éch. 20/11/2035	9 226	8 576	0,01
8,466 % éch. 16/10/2062	25 165	31 673	0,05	3,223 % éch. 25/03/2037 ^	274	236	0,00	4,241 % éch. 25/09/2034	33	31	0,00
9,466 % éch. 16/10/2062	18 898	23 706	0,04	3,564 % éch. 25/08/2047 ^	235	202	0,00	4,290 % éch. 25/04/2036 ^	196	167	0,00
BWAY Mortgage Trust				3,584 % éch. 25/03/2037 ^	4 104	3 525	0,01	4,826 % éch. 25/11/2046	5 696	4 839	0,01
2,917 % éch. 10/01/2035	\$ 20 818	15 842	0,03	3,839 % éch. 25/10/2035 ^	75	65	0,00	4,916 % éch. 25/06/2046	4 646	3 747	0,01
BX Trust				3,853 % éch. 25/04/2036	761	450	0,00	4,976 % éch. 25/12/2035	964	860	0,00
6,243 % éch. 15/05/2030	8 100	8 019	0,01	3,915 % éch. 25/05/2042	945	862	0,00	4,976 % éch. 25/02/2036	135	124	0,00
7,413 % éch. 15/05/2035	662	648	0,00	3,953 % éch. 20/02/2036	1 731	1 530	0,00	5,000 % éch. 25/08/2035 ^	2 484	1 760	0,00
8,468 % éch. 15/07/2034	26 941	26 872	0,04	3,974 % éch. 25/09/2037	2 232	1 931	0,00	5,250 % éch. 25/06/2035	701	542	0,00
9,568 % éch. 15/07/2034	2 662	2 642	0,01	4,001 % éch. 25/03/2037 ^	1 267	1 096	0,00	5,250 % éch. 25/10/2035	218	150	0,00
BXP Trust				4,100 % éch. 25/03/2036 ^	330	301	0,00	5,286 % éch. 20/07/2035 ^	76	67	0,00
3,379 % éch. 13/06/2039	90 000	80 777	0,13	4,145 % éch. 25/01/2082	25 909	22 478	0,04	5,326 % éch. 25/08/2035	363	289	0,00
Canada Square Funding PLC				4,155 % éch. 25/06/2036 ^	1 313	1 215	0,00	5,337 % éch. 20/02/2047 ^	1 750	1 366	0,00
5,316 % éch. 17/01/2059	£ 3 282	4 148	0,01	4,213 % éch. 25/11/2036 ^	2 134	1 916	0,00	5,347 % éch. 20/03/2047	6 155	5 070	0,01
5,682 % éch. 17/06/2058	15 541	19 652	0,03	4,223 % éch. 25/04/2037 ^	1 537	1 338	0,00	5,352 % éch. 20/12/2046 ^	8 605	7 211	0,01
5,852 % éch. 17/06/2058	13 964	17 666	0,03	4,288 % éch. 25/07/2037 ^	1 246	1 086	0,00	5,356 % éch. 25/11/2047 ^	4 292	3 544	0,01
6,152 % éch. 17/12/2057	10 497	13 371	0,02	4,408 % éch. 25/09/2064	13 614	10 565	0,02	5,376 % éch. 25/08/2035	693	651	0,00
Canterbury Finance PLC				4,418 % éch. 25/08/2035 ^	378	313	0,00	5,390 % éch. 25/06/2036	1 762	1 596	0,00
5,377 % éch. 16/05/2058	4 457	5 660	0,01	4,423 % éch. 25/07/2036 ^	130	94	0,00	5,390 % éch. 25/12/2046	676	588	0,00
7,111 % éch. 16/05/2056	1 842	2 348	0,00	5,139 % éch. 25/11/2036	536	398	0,00	5,410 % éch. 25/03/2047 ^	4 532	3 523	0,01
Cascade Funding Mortgage Trust				5,278 % éch. 25/08/2036	11 161	4 599	0,01	5,430 % éch. 25/08/2037	6 904	6 046	0,01
4,000 % éch. 25/10/2068	\$ 9 410	9 109	0,02	5,280 % éch. 25/06/2036	5 410	5 084	0,01	5,430 % éch. 25/04/2047	5 725	5 100	0,01
Chase Mortgage Finance Trust				5,470 % éch. 25/09/2036	343	323	0,00	5,437 % éch. 20/09/2046	5 259	3 792	0,01
3,883 % éch. 25/12/2035 ^	2 059	1 882	0,00	5,470 % éch. 25/01/2037	3 390	2 893	0,01	5,450 % éch. 25/08/2035 ^	266	168	0,00
3,938 % éch. 25/12/2035 ^	91	78	0,00	5,500 % éch. 25/09/2035	908	880	0,00	5,450 % éch. 25/11/2035 ^	782	83	0,00
3,948 % éch. 25/01/2036 ^	530	466	0,00	5,650 % éch. 25/09/2036	3 182	3 003	0,01	5,470 % éch. 25/09/2047	3 403	2 957	0,01
3,962 % éch. 25/03/2037 ^	761	708	0,00	5,655 % éch. 25/07/2036 ^	1 539	1 169	0,00	5,490 % éch. 25/05/2047	3 378	2 911	0,01
4,086 % éch. 25/03/2037 ^	2 925	2 725	0,01	5,750 % éch. 25/11/2035 ^	2 527	1 896	0,00	5,500 % éch. 25/04/2035	2 382	2 000	0,00
4,477 % éch. 25/07/2037	151	92	0,00	6,000 % éch. 25/12/2035	1 293	1 224	0,00	5,500 % éch. 25/05/2035 ^	3 033	2 331	0,00
4,529 % éch. 25/07/2037	513	394	0,00	6,000 % éch. 25/11/2036	44	42	0,00	5,500 % éch. 25/05/2035	2 502	2 051	0,00
4,725 % éch. 25/02/2037	188	178	0,00	6,000 % éch. 25/08/2037	1 367	537	0,00	5,500 % éch. 25/06/2035 ^	3 450	2 479	0,01
4,739 % éch. 25/02/2037	1 220	1 163	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				5,500 % éch. 25/06/2035 ^	863	502	0,00
5,165 % éch. 25/02/2037	1 120	1 057	0,00	3,827 % éch. 25/04/2035	407	383	0,00	5,500 % éch. 25/07/2035 ^	279	205	0,00
5,250 % éch. 25/05/2035	0	0	0,00	3,928 % éch. 25/05/2035	163	157	0,00	5,500 % éch. 25/07/2035	1 616	1 307	0,00
5,500 % éch. 25/11/2035	2 177	1 638	0,00	3,994 % éch. 25/12/2035 ^	521	342	0,00	5,500 % éch. 25/08/2035 ^	2 856	2 271	0,00
6,000 % éch. 25/05/2036	2 751	1 281	0,00	4,326 % éch. 25/08/2035	2 167	1 802	0,00	5,500 % éch. 25/09/2035 ^	4 748	3 540	0,01
6,000 % éch. 25/11/2036 ^	943	414	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates				5,500 % éch. 25/09/2035 ^	1 924	1 181	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037 ^	2 501	1 200	0,00	3,626 % éch. 25/09/2035 ^	1 324	1 148	0,00	5,500 % éch. 25/10/2035	698	422	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037	5 770	2 596	0,01	CitiMortgage Alternative Loan Trust				5,500 % éch. 25/11/2035 ^	3 303	2 067	0,00
ChaseFlex Trust				5,500 % éch. 25/04/2036							

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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. 25/04/2036	\$ 519	\$ 404	0,00	6,000 % éch. 25/08/2037 ^	\$ 15 873	\$ 8 246	0,01	6,000 % éch. 25/08/2037	\$ 3 442	\$ 1 622	0,00
5,500 % éch. 25/05/2036 ^	2 140	877	0,00	6,000 % éch. 25/02/2047 ^	2 145	1 090	0,00	6,000 % éch. 25/10/2037	1 279	944	0,00
5,500 % éch. 25/10/2036 ^	1 489	693	0,00	6,050 % éch. 25/12/2036 ^	779	261	0,00	6,000 % éch. 25/01/2038 ^	6 775	3 279	0,01
5,500 % éch. 25/11/2036	5 146	4 249	0,01	6,170 % éch. 25/03/2037 ^	955	544	0,00	6,250 % éch. 25/09/2036 ^	475	207	0,00
5,500 % éch. 25/04/2037 ^	491	268	0,00	6,250 % éch. 25/02/2036 ^	70	54	0,00	6,500 % éch. 25/12/2037	4 820	2 119	0,00
5,510 % éch. 25/09/2046	1 908	1 662	0,00	6,250 % éch. 25/11/2036 ^	407	196	0,00	6,537 % éch. 25/02/2036 ^	1 657	1 516	0,00
5,510 % éch. 25/05/2047	297	256	0,00	6,500 % éch. 25/08/2032	7	7	0,00	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
5,510 % éch. 25/06/2047	4 772	3 948	0,01	6,500 % éch. 25/09/2037 ^	9 273	3 811	0,01	4,237 % éch. 25/01/2034 ^	187	153	0,00
5,520 % éch. 25/02/2037 ^	747	228	0,00	6,610 % éch. 25/11/2035	6 458	5 932	0,01	5,570 % éch. 25/07/2036	335	306	0,00
5,530 % éch. 25/07/2046 ^	1 385	1 341	0,00	6,750 % éch. 25/10/2036 ^	1 406	422	0,00	6,000 % éch. 25/03/2035 ^	321	303	0,00
5,530 % éch. 25/08/2046	14 571	12 247	0,02	7,000 % éch. 25/10/2037	5 680	2 152	0,00	Countrywide Mortgage-Backed Securities, Inc.			
5,550 % éch. 25/05/2036	4 089	3 517	0,01	7,500 % éch. 25/07/2036	1 808	1 265	0,00	5,945 % éch. 27/11/2035	265	245	0,00
5,550 % éch. 25/12/2036 ^	4 183	896	0,00	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				Countrywide, Inc.			
5,550 % éch. 25/04/2037 ^	2 048	662	0,00	5,630 % éch. 25/04/2036 ^	794	670	0,00	5,693 % éch. 27/11/2035	0	0	0,00
5,570 % éch. 25/07/2046 ^	4 691	4 160	0,01	5,870 % éch. 25/11/2035	121	116	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
5,570 % éch. 25/07/2046 ^	1 121	930	0,00	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				3,672 % éch. 25/06/2046	23 780	21 663	0,03
5,576 % éch. 25/08/2035 ^	1 833	1 460	0,00	2,050 % éch. 25/05/2036				4,255 % éch. 25/03/2033	71	67	0,00
5,577 % éch. 20/03/2046	5 134	4 205	0,01	(a)	335	52	0,00	5,000 % éch. 25/07/2035 ^	591	538	0,00
5,577 % éch. 20/05/2046 ^	15 819	13 425	0,02	2,961 % éch. 25/02/2035	2 013	1 637	0,00	5,500 % éch. 25/07/2035	1 417	1 294	0,00
5,590 % éch. 25/09/2047	4 444	3 842	0,01	3,250 % éch. 25/05/2047	2 466	2 077	0,00	6,000 % éch. 25/12/2035 ^	1 869	868	0,00
5,610 % éch. 25/03/2036	3 112	3 006	0,01	3,413 % éch. 20/01/2035	61	53	0,00	6,500 % éch. 25/12/2035 ^	426	217	0,00
5,610 % éch. 25/11/2036 ^	3 395	2 946	0,01	3,514 % éch. 25/04/2035 ^	1 715	1 319	0,00	7,000 % éch. 25/12/2035 ^	1 296	264	0,00
5,621 % éch. 25/06/2035	2 003	1 774	0,00	3,656 % éch. 25/03/2037	361	330	0,00	7,000 % éch. 25/01/2036 ^	4 856	773	0,00
5,623 % éch. 20/07/2035	1 653	1 535	0,00	3,673 % éch. 25/11/2037	1 436	1 332	0,00	Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates			
5,630 % éch. 25/07/2035	1 314	1 052	0,00	3,677 % éch. 20/02/2036	2 388	2 049	0,00	4,053 % éch. 25/10/2033	5	5	0,00
5,630 % éch. 25/01/2037	3 351	2 731	0,01	3,680 % éch. 20/09/2036 ^	2 312	2 002	0,00	5,582 % éch. 25/07/2035	2 136	2 028	0,00
5,650 % éch. 25/07/2036 ^	2 285	996	0,00	3,718 % éch. 20/03/2036	423	343	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
5,650 % éch. 25/09/2036	111	46	0,00	3,787 % éch. 25/04/2037 ^	1 642	1 479	0,00	3,424 % éch. 27/02/2046	6 564	3 679	0,01
5,650 % éch. 25/05/2037 ^	1 780	599	0,00	3,793 % éch. 20/02/2036	739	647	0,00	3,519 % éch. 30/11/2037	7 521	6 905	0,01
5,650 % éch. 25/05/2037	149	65	0,00	3,797 % éch. 20/04/2036	1 143	997	0,00	3,778 % éch. 26/08/2036	4 228	3 644	0,01
5,650 % éch. 25/06/2037	3 497	2 931	0,01	3,810 % éch. 25/11/2034	35	31	0,00	3,809 % éch. 27/07/2037	730	708	0,00
5,650 % éch. 25/09/2037	831	334	0,00	3,876 % éch. 25/11/2037	1 614	1 426	0,00	3,910 % éch. 27/02/2036	2 486	1 769	0,00
5,650 % éch. 25/07/2046	2 688	2 358	0,00	3,906 % éch. 20/04/2035	115	110	0,00	3,975 % éch. 27/01/2036	3 219	3 065	0,01
5,670 % éch. 25/07/2035	1 275	1 114	0,00	3,910 % éch. 20/04/2035	538	500	0,00	4,255 % éch. 26/06/2036	3 332	2 869	0,01
5,670 % éch. 25/12/2035	1 037	935	0,00	3,927 % éch. 20/06/2036	1 710	1 476	0,00	4,409 % éch. 27/07/2037	1 010	932	0,00
5,690 % éch. 25/01/2036	2 481	2 232	0,00	3,929 % éch. 20/05/2036	1 518	1 426	0,00	4,847 % éch. 27/11/2036	13 173	15 690	0,03
5,690 % éch. 25/07/2036	2 735	2 330	0,00	3,937 % éch. 20/05/2036 ^	1 145	1 020	0,00	5,300 % éch. 29/09/2036	292	281	0,00
5,710 % éch. 25/08/2035	2 943	2 615	0,01	4,012 % éch. 20/12/2035	344	312	0,00	5,418 % éch. 27/10/2036	8 855	6 659	0,01
5,710 % éch. 25/02/2037	4 928	4 081	0,01	4,028 % éch. 25/01/2036 ^	189	175	0,00	5,750 % éch. 26/12/2035	399	290	0,00
5,710 % éch. 25/10/2046	7 334	6 773	0,01	4,041 % éch. 20/09/2035	1 378	1 234	0,00	6,000 % éch. 25/07/2037 ^	856	717	0,00
5,710 % éch. 25/08/2047 ^	5 612	4 576	0,01	4,070 % éch. 20/12/2035	45	42	0,00	18,431 % éch. 27/11/2037	480	480	0,00
5,730 % éch. 25/02/2036 ^	1 110	983	0,00	4,172 % éch. 20/09/2035	45	69	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
5,750 % éch. 25/07/2035 ^	121	78	0,00	4,241 % éch. 20/10/2034	222	190	0,00	5,500 % éch. 25/08/2036 ^	1 157	833	0,00
5,750 % éch. 25/10/2035	511	376	0,00	4,249 % éch. 25/08/2034 ^	390	350	0,00	5,942 % éch. 25/02/2037 ^	1 037	257	0,00
5,750 % éch. 25/12/2035	1 762	1 338	0,00	4,344 % éch. 20/06/2035	4	4	0,00	6,000 % éch. 25/10/2021 ^	11	5	0,00
5,750 % éch. 25/01/2036	1 379	1 241	0,00	4,344 % éch. 20/06/2035	16	15	0,00	6,000 % éch. 25/03/2036 ^	4 025	1 816	0,00
5,750 % éch. 25/05/2036	3 291	1 394	0,00	4,366 % éch. 19/01/2034	8	7	0,00	6,396 % éch. 25/04/2036	278	150	0,00
5,750 % éch. 25/05/2036 ^	5 663	2 394	0,00	4,630 % éch. 20/10/2034	398	351	0,00	6,421 % éch. 25/10/2037	4 347	2 697	0,01
5,750 % éch. 25/10/2036	641	249	0,00	4,741 % éch. 20/07/2034	141	129	0,00	Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
5,750 % éch. 25/03/2037	579	518	0,00	5,450 % éch. 25/05/2036	335	102	0,00	2,500 % éch. 25/07/2057	59 164	51 586	0,08
5,750 % éch. 25/03/2037 ^	2 955	1 618	0,00	5,500 % éch. 25/05/2035	586	480	0,00	2,873 % éch. 25/12/2048	12 380	10 546	0,02
5,750 % éch. 25/06/2037	10 662	4 955	0,01	5,500 % éch. 25/09/2035 ^	414	376	0,00	2,995 % éch. 25/07/2057	3 608	2 738	0,01
5,763 % éch. 20/11/2035	1 399	1 303	0,00	5,500 % éch. 25/10/2035 ^	913	557	0,00	3,076 % éch. 25/02/2056	156 511	124 398	0,19
5,770 % éch. 25/08/2035 ^	1 361	1 215	0,00	5,500 % éch. 25/11/2035 ^	494	310	0,00	3,105 % éch. 25/07/2057	52 865	31 474	0,05
5,790 % éch. 25/11/2035	807	649	0,00	5,550 % éch. 25/08/2035	2 355	1 614	0,00	3,257 % éch. 25/07/2058	276 092	215 153	0,33
5,803 % éch. 20/11/2035	8 144	7 015	0,01	5,550 % éch. 25/09/2037 ^	4 085	1 764	0,00	3,398 % éch. 25/09/2048	12 912	10 878	0,02
5,830 % éch. 25/09/2035	633	378	0,00	5,550 % éch. 25/04/2046	2 283	1 922	0,00	3,726 % éch. 25/10/2058	521	439	0,00
5,850 % éch. 25/09/2035	4 466	4 038	0,01	5,630 % éch. 25/03/2036	3 774	3 463	0,01	3,806 % éch. 25/06/2048	47 608	39 409	0,06
5,850 % éch. 25/05/2036	4 162	1 872	0,00	5,730 % éch. 25/04/2035	1 129	1 043	0,00	4,277 % éch. 25/04/2058	51 550	46 950	0,07
6,000 % éch. 25/03/2027 ^	20	19	0,00	5,730 % éch. 25/04/2035	103	92	0,00	4,281 % éch. 25/09/2057	29 631	25 252	0,04
6,000 % éch. 25/11/2034	3 585	3 512	0,01	5,750 % éch. 25/12/2035 ^	1 308	667	0,00	4,878 % éch. 25/09/2057	1 248	1 073	0,00
6,000 % éch. 25/12/2034	736	656	0,00	5,750 % éch. 25/06/2037	1 910	1 009	0,00	4,953 % éch. 01/06/2050	102 687	101 821	0,16
6,000 % éch. 25/02/2035	1 352	1 153	0,00	5,770 % éch. 25/03/2035	1 242	1 063	0,00	5,943 % éch. 15/07/2032	31 309	29 860	0,05
6,000 % éch. 25/08/2035 ^	55	25	0,00	5,790 % éch. 25/03/2035	1 606	1 413	0,00	6,193 % éch. 15/07/2032	22 200	21 021	0,03
6,000 % éch. 25/12/2035 ^	3 831	2 898	0,01	5,810 % éch. 25/02/2035	2 047	1 647	0,00	7,093 % éch. 15/07/2032	9 193	8 348	0,01
6,000 % éch. 25/01/2036 ^	2 024	1 464	0,00	5,830 % éch. 25/03/2035 ^	11	10	0,00	DBUS Mortgage Trust			
6,000 % éch. 25/02/2036	1 681	1 464	0,00	5,830 % éch. 25/04/2046	6 827	2 048	0,00	3,452 % éch. 10/10/2034	2 000	1 809	0,00
6,000 % éch. 25/03/2036	3 198	1 480	0,00	5,850 % éch. 25/02/2035	2 727	2 380	0,00	DBWF Mortgage Trust			
6,000 % éch. 25/04/2036 ^	6 496	3 290	0,01	5,850 % éch. 25/05/2036 ^	262	121	0,00	6,276 % éch. 19/12/2030	23 789	23 470	0,04
6,000 % éch. 25/04/2036	1 561	863	0,00	5,870 % éch. 25/03/2035	684	597	0,00	7,646 % éch. 19/12/2030	9 300	9 096	0,02
6,000 % éch. 25/05/2036 ^	42	18	0,00	5,890 % éch. 25/02/2035	2 475	2 138	0,00	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
6,000 % éch. 25/08/2036 ^	17 132	11 701	0,02	5,910 % éch. 25/09/2034	105	97	0,00	5,290 % éch. 25/07/2047	9 229	8 424	0,01
6,000 % éch. 25/10/2036 ^	497	297	0,00	6,000 % éch. 25/04/2036	1 129	611	0,00	5,350 % éch. 25/08/2047	2 820	2 538	0,01
6,000 % éch. 25/10/2036 ^	4 221	2 417	0,01	6,000 % éch. 25/05/2036	2 229	1 084	0,00	5,390 % éch. 25/08/2036 ^	503	455	0,00
6,000 % éch. 25/11/2036 ^	3 746	2 262	0,00	6,000 % éch. 25/07/2036	2 466	1 338	0,00	5,410 % éch. 25/08/2047	5 387	4 828	0,01
6,000 % éch. 25/12/2036 ^	2 115	640	0,00	6,000 % éch. 25/02/2037 ^	40	20	0,00	5,450 % éch. 25/03/2037 ^	6 039	5 698	0,01
6,000 % éch. 25/01/2037 ^	1 313	860	0,00	6,000 % éch. 25/02/2037	1 444	754	0,00	5,450 % éch. 25/09/2047 ^	11 383	9 693	0,02
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	10 668	4 443	0,01	6,000 % éch. 25/03/2037	1 320	667	0,				

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
5,530 % éch. 25/10/2036 ^	\$ 15 823	\$ 4 945	0,01	4,900 % éch. 25/08/2037 ^	\$ 239	\$ 80	0,00	6,500 % éch. 25/05/2036	\$ 937	\$ 321	0,00
5,530 % éch. 25/12/2036	1 951	696	0,00	6,000 % éch. 25/05/2036	172	80	0,00	6,970 % éch. 25/05/2034	21	17	0,00
5,530 % éch. 25/02/2037 ^	2 396	2 063	0,00	6,000 % éch. 25/08/2037 ^	247	103	0,00				
5,530 % éch. 25/08/2047	5 777	5 170	0,01	Fondo de Titulización de Activos UCI				HarborView Mortgage Loan Trust			
5,630 % éch. 25/01/2047	2 695	2 457	0,01	3,672 % éch. 16/06/2049	€ 10 745	11 044	0,02	3,827 % éch. 19/06/2036 ^	2 180	1 190	0,00
5,710 % éch. 25/08/2036	3 386	3 054	0,01	FWD Securitization Trust				4,061 % éch. 19/11/2034	343	319	0,00
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				2,240 % éch. 25/01/2050	\$ 6 599	5 996	0,01	4,201 % éch. 19/07/2035 ^	19	14	0,00
3,238 % éch. 25/08/2035 ^	622	553	0,00	GC Pastor Hipotecario FTA				4,596 % éch. 19/12/2035 ^	552	521	0,00
3,910 % éch. 25/02/2036 ^	367	262	0,00	3,721 % éch. 21/06/2046	€ 1 359	1 281	0,00	4,720 % éch. 25/02/2036 ^	147	54	0,00
4,042 % éch. 25/10/2035	2 042	1 806	0,00	Glen Securities Finance DAC				4,826 % éch. 19/12/2036 ^	1 899	1 616	0,00
5,350 % éch. 25/11/2035 ^	2	1	0,00	5,342 % éch. 28/10/2038	3 538	3 806	0,01	5,337 % éch. 19/11/2036	16 874	14 945	0,02
5,500 % éch. 25/11/2035	783	749	0,00	6,342 % éch. 28/10/2038	2 673	2 844	0,01	5,337 % éch. 19/11/2046 ^	881	649	0,00
5,500 % éch. 25/12/2035 ^	645	522	0,00	7,142 % éch. 28/10/2038	1 277	1 361	0,00	5,347 % éch. 19/09/2037	8 823	7 731	0,01
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust				Glenbeigh Issuer DAC				5,417 % éch. 19/03/2037	4 773	4 293	0,01
6,005 % éch. 25/10/2036 ^	1 316	1 063	0,00	4,350 % éch. 24/06/2050	7 304	7 931	0,01	5,457 % éch. 25/01/2047	11 909	10 792	0,02
6,445 % éch. 25/02/2036 ^	3 773	3 288	0,01	GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.				5,476 % éch. 19/09/2035 ^	98	86	0,00
Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				5,456 % éch. 10/03/2051	\$ 18 169	16 582	0,03	5,497 % éch. 19/12/2036 ^	524	490	0,00
4,813 % éch. 25/06/2036	251	213	0,00	5,550 % éch. 10/08/2038	19 032	17 996	0,03	5,537 % éch. 19/01/2038	9 667	8 952	0,02
4,813 % éch. 25/06/2036 ^	1 889	1 642	0,00	GMAC Mortgage Corp. Loan Trust				5,567 % éch. 19/12/2036	36 251	30 293	0,05
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.				3,281 % éch. 19/04/2036 ^	302	236	0,00	5,577 % éch. 19/11/2036	13 602	11 854	0,02
6,500 % éch. 27/07/2037	527	416	0,00	3,351 % éch. 19/11/2035 ^	59	50	0,00	5,597 % éch. 19/05/2035	3 001	2 747	0,01
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				3,742 % éch. 18/03/2035	15	13	0,00	5,657 % éch. 19/01/2036	3 195	1 980	0,00
6,125 % éch. 25/06/2034	241	237	0,00	4,750 % éch. 19/07/2035	148	127	0,00	5,697 % éch. 19/03/2035	618	607	0,00
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates				Great Hall Mortgages PLC				5,717 % éch. 20/10/2045	3 845	2 468	0,01
4,057 % éch. 27/06/2037	510	453	0,00	4,102 % éch. 18/06/2039	€ 800	784	0,00	5,746 % éch. 19/04/2034	67	60	0,00
Domi BV				4,772 % éch. 18/06/2039	8 800	8 603	0,01	5,777 % éch. 19/09/2035	8 655	4 663	0,01
4,376 % éch. 15/06/2051	€ 5 523	6 029	0,01	5,152 % éch. 18/03/2039	€ 3 074	3 875	0,01	5,777 % éch. 19/11/2035	159	115	0,00
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				5,166 % éch. 18/06/2039	95	120	0,00	5,797 % éch. 19/08/2045	2 470	1 913	0,00
5,347 % éch. 19/10/2036	\$ 6 164	5 112	0,01	5,172 % éch. 18/06/2038	2 005	2 529	0,01	5,837 % éch. 19/01/2035	160	151	0,00
5,357 % éch. 19/10/2036	3 907	2 736	0,01	5,644 % éch. 18/06/2039	\$ 192	190	0,00	5,976 % éch. 19/10/2035	6 639	3 861	0,01
5,737 % éch. 19/10/2045	3 216	2 751	0,01	5,802 % éch. 18/03/2039	€ 1 710	1 952	0,00	5,976 % éch. 19/01/2036 ^	957	407	0,00
5,897 % éch. 19/10/2045	2 860	2 638	0,01	6,277 % éch. 18/06/2039	2 000	2 277	0,00	6,150 % éch. 25/10/2037	11 940	11 051	0,02
5,977 % éch. 19/09/2044	7	6	0,00	Greenpoint Mortgage Funding Trust				6,226 % éch. 19/07/2045	19	16	0,00
Dragon Finance BV				5,550 % éch. 25/10/2046	\$ 6 771	6 209	0,01	6,507 % éch. 20/06/2035	901	783	0,00
4,571 % éch. 13/07/2023	€ 1 299	1 651	0,00	5,570 % éch. 25/04/2036	295	253	0,00	6,697 % éch. 19/02/2036	1 853	1 002	0,00
Dutch Property Finance BV				5,590 % éch. 25/06/2045	694	648	0,00	Harbour			
3,892 % éch. 28/07/2054	€ 11 868	12 915	0,02	5,670 % éch. 25/10/2045	3 327	3 262	0,01	5,358 % éch. 28/01/2054	€ 20 691	26 202	0,04
4,168 % éch. 28/04/2064	48 969	53 555	0,08	5,730 % éch. 25/02/2036	1 470	1 276	0,00	5,457 % éch. 28/01/2054	14 500	18 183	0,03
Eurohome UK Mortgages PLC				5,770 % éch. 25/10/2045	2 447	2 228	0,00	Hilton Orlando Trust			
5,137 % éch. 15/06/2044	€ 3 332	4 070	0,01	Grifonas Finance PLC				9,093 % éch. 15/12/2034	\$ 2 213	2 128	0,00
5,351 % éch. 15/09/2044	5 250	6 322	0,01	3,513 % éch. 28/08/2039	€ 18 519	19 242	0,03	Hipocot FTA			
5,601 % éch. 15/09/2044	7 250	8 504	0,01	GS Mortgage Securities Corp. Trust				3,351 % éch. 24/10/2039	€ 1 725	1 862	0,00
European Loan Conduit DAC				3,419 % éch. 10/10/2032	\$ 91	89	0,00	HomeBanc Mortgage Trust			
4,358 % éch. 17/02/2030	€ 64 025	68 395	0,11	4,744 % éch. 10/10/2032	35 288	33 096	0,05	3,864 % éch. 25/04/2037	\$ 538	483	0,00
Eurosail PLC				GS Mortgage Securities Corp. Trust				4,203 % éch. 25/04/2047	1 037	899	0,00
3,629 % éch. 13/03/2045	37	40	0,00	6,990 % éch. 15/07/2025	12 349	12 064	0,02	5,670 % éch. 25/01/2036	561	534	0,00
3,709 % éch. 13/03/2045	5 450	5 691	0,01	8,193 % éch. 15/11/2032	19 350	18 476	0,03	5,885 % éch. 25/01/2036	6 736	5 704	0,01
3,766 % éch. 15/12/2044	732	787	0,00	GSC Capital Corp. Mortgage Trust				5,890 % éch. 25/12/2034	59	55	0,00
3,936 % éch. 10/09/2044	3 200	3 292	0,01	5,550 % éch. 25/02/2036 ^	1 670	1 514	0,00	Hops Hill PLC			
5,140 % éch. 13/03/2045	€ 1 362	1 711	0,00	GSMPs Mortgage Loan Trust				5,854 % éch. 27/05/2054	€ 25 818	32 867	0,05
5,150 % éch. 13/03/2045	2	2	0,00	3,731 % éch. 25/06/2034	4 227	3 896	0,01	HSI Asset Loan Obligation Trust			
5,433 % éch. 10/09/2044	1 200	1 442	0,00	5,500 % éch. 25/03/2035	6 094	5 331	0,01	1,480 % éch. 25/12/2036	\$ 1 493	145	0,00
5,760 % éch. 13/09/2045	12 771	15 421	0,03	5,500 % éch. 25/09/2035	7 076	5 988	0,01	(a)			
5,940 % éch. 13/06/2045	11 883	14 911	0,02	5,550 % éch. 25/06/2034	1 356	1 193	0,00	5,520 % éch. 25/12/2036	1 915	385	0,00
5,989 % éch. 13/06/2045	1 321	1 535	0,00	7,059 % éch. 20/10/2032	1 246	1 086	0,00	Impac CMB Trust			
Finsbury Square PLC				GSMSC Resecuritization Trust				5,690 % éch. 25/05/2035	176	163	0,00
5,689 % éch. 16/12/2071	4 206	5 321	0,01	3,126 % éch. 26/04/2037	9 344	2 596	0,01	5,780 % éch. 25/02/2036	1 520	1 217	0,00
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				4,310 % éch. 26/08/2035	90	90	0,00	5,790 % éch. 25/11/2034	1 173	1 134	0,00
4,203 % éch. 25/09/2035 ^	\$ 156	129	0,00	5,318 % éch. 26/09/2036	8 104	5 388	0,01	5,790 % éch. 25/03/2035	2 560	2 346	0,00
4,386 % éch. 25/03/2035	613	383	0,00	GSR Mortgage Loan Trust				5,830 % éch. 25/01/2035	1 998	1 868	0,00
4,732 % éch. 25/11/2035 ^	1 579	1 039	0,00	3,575 % éch. 25/03/2047 ^	5 635	3 679	0,01	6,060 % éch. 25/10/2034	335	327	0,00
4,767 % éch. 25/02/2037 ^	395	225	0,00	3,704 % éch. 25/05/2037 ^	1 304	752	0,00	Impac Secured Assets CMN Owner Trust			
4,878 % éch. 25/02/2036	112	84	0,00	3,733 % éch. 25/04/2036 ^	3 713	2 553	0,01	5,450 % éch. 25/03/2033	220	210	0,00
5,118 % éch. 25/01/2037 ^	797	594	0,00	3,845 % éch. 25/05/2037	2 928	2 693	0,01	Impac Secured Assets Corp.			
5,139 % éch. 25/11/2036 ^	820	592	0,00	3,935 % éch. 25/01/2036	839	821	0,00	5,790 % éch. 25/03/2036	1 289	1 029	0,00
5,500 % éch. 25/11/2035	71	37	0,00	4,310 % éch. 25/05/2037 ^	122	104	0,00	6,575 % éch. 25/02/2035	335	336	0,00
6,000 % éch. 25/05/2036 ^	687	305	0,00	4,660 % éch. 25/07/2035	11	11	0,00	Impac Secured Assets Trust			
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	379	164	0,00	5,024 % éch. 25/10/2035 ^	86	77	0,00	5,370 % éch. 25/05/2037 ^	560	440	0,00
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	365	154	0,00	5,380 % éch. 25/05/2037	12 202	6 259	0,01	5,550 % éch. 25/11/2036	526	521	0,00
6,250 % éch. 25/11/2036	2 082	696	0,00	5,500 % éch. 25/06/2035	2 046	1 858	0,00	5,630 % éch. 25/09/2037 ^	4 554	3 747	0,01
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				5,500 % éch. 25/07/2035	494	445	0,00	5,630 % éch. 25/09/2037 ^	2 763	2 295	0,00
3,379 % éch. 25/11/2036 ^	380	259	0,00	5,590 % éch. 25/08/2046	18 042	4 359	0,01	5,670 % éch. 25/01/2037	8 753	7 008	0,01
3,858 % éch. 25/07/2037 ^	238	154	0,00	5,670 % éch. 25/08/2046	15 076	3 959	0,01	5,690 % éch. 25/11/2036	6 342	4 864	0,01
4,032 % éch. 25/01/2036 ^	28	16	0,00	5,750 % éch. 25/03/2036 ^	228	203	0,00	5,690 % éch. 25/02/2037 ^	4 971	4 423	0,01
4,267 % éch. 25/09/2035	5	5	0,00	5,750 % éch. 25/05/2037 ^	139	301	0,00	5,850 % éch. 25/05/2036	399	341	0,00
4,283 % éch. 25/11/2037 ^	458	398	0,00	6,000 % éch. 25/02/2036	1 804	933	0,00	5,870 % éch. 25/09/2037	2 357	1 929	0,00
				6,000 % éch. 25/07/2036	1 880	1 117	0,00	IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust			
				6,000 % éch. 25/							

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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	
3,233 % éch. 25/08/2037 ^	\$ 4 695	\$ 3 592	0,01	4,128 % éch. 05/07/2031	\$ 28 120	\$ 25 676	0,04	6,000 % éch. 25/12/2036	\$ 1 124	\$ 939	0,00	
3,261 % éch. 25/06/2036	5 568	3 690	0,01	4,549 % éch. 05/07/2033	3 809	3 364	0,01	6,050 % éch. 25/12/2035 ^	592	359	0,00	
3,314 % éch. 25/07/2037	6 867	5 975	0,01	4,950 % éch. 05/07/2033	38 900	33 614	0,05	Lehman XS Trust				
3,317 % éch. 25/05/2037 ^	1 561	1 285	0,00	5,337 % éch. 15/05/2047	1 105	1 034	0,00	4,976 % éch. 25/11/2035	94	90	0,00	
3,335 % éch. 25/04/2037	3 641	3 012	0,01	5,350 % éch. 05/07/2033	9 940	8 401	0,01	5,390 % éch. 25/08/2036 ^	52	52	0,00	
3,365 % éch. 25/05/2035 ^	226	180	0,00	6,293 % éch. 15/12/2036	17 100	15 017	0,02	5,420 % éch. 25/02/2036	314	281	0,00	
3,438 % éch. 25/03/2036 ^	3 449	2 442	0,01	6,743 % éch. 15/02/2035	2 184	2 104	0,00	5,450 % éch. 25/11/2035	4 318	4 235	0,01	
3,442 % éch. 25/08/2037	2 781	1 894	0,00	7,063 % éch. 05/07/2033	10 109	9 028	0,02	5,476 % éch. 25/03/2047	2 909	2 739	0,01	
3,446 % éch. 25/08/2036	158	124	0,00	JPMorgan Mortgage Trust				5,530 % éch. 25/12/2036	5 441	4 293	0,01	
3,457 % éch. 25/04/2037	6 836	5 776	0,01	3,655 % éch. 27/07/2037	456	412	0,00	5,530 % éch. 25/09/2046	121	103	0,00	
3,482 % éch. 25/08/2035	63	47	0,00	3,853 % éch. 25/05/2036 ^	40	34	0,00	5,550 % éch. 25/08/2046	4 235	3 886	0,01	
3,534 % éch. 25/11/2035 ^	35	24	0,00	3,859 % éch. 25/04/2037 ^	3	2	0,00	5,550 % éch. 25/11/2046 ^	768	705	0,00	
3,549 % éch. 25/03/2037 ^	16	13	0,00	3,881 % éch. 25/01/2037 ^	1 336	1 082	0,00	5,550 % éch. 25/03/2047 ^	14 531	12 439	0,02	
3,558 % éch. 25/05/2037 ^	2 025	1 377	0,00	3,904 % éch. 25/10/2036	201	145	0,00	5,550 % éch. 25/08/2047 ^	5 683	4 728	0,01	
3,561 % éch. 25/09/2036	1 413	966	0,00	3,909 % éch. 25/11/2035 ^	760	662	0,00	5,560 % éch. 25/08/2046	8 175	7 431	0,01	
3,570 % éch. 25/09/2036 ^	104	88	0,00	3,909 % éch. 25/11/2035	2 511	2 185	0,00	5,570 % éch. 25/11/2046	13 337	11 644	0,02	
3,641 % éch. 25/05/2036 ^	155	136	0,00	3,912 % éch. 25/08/2035 ^	186	157	0,00	5,590 % éch. 25/06/2047	5 746	5 187	0,01	
3,651 % éch. 25/01/2037 ^	159	128	0,00	3,912 % éch. 25/08/2036	102	75	0,00	5,650 % éch. 25/08/2037	2 870	2 620	0,01	
3,688 % éch. 25/09/2035 ^	292	197	0,00	3,921 % éch. 25/11/2035 ^	1 760	1 445	0,00	5,670 % éch. 25/02/2046 ^	8 731	7 737	0,01	
3,695 % éch. 25/07/2036	3 383	2 408	0,00	3,927 % éch. 25/05/2036	1 337	1 103	0,00	6,050 % éch. 25/08/2047 ^	10 055	8 434	0,01	
3,699 % éch. 25/12/2035	3 421	2 596	0,01	3,937 % éch. 25/08/2035	613	609	0,00	6,850 % éch. 25/09/2047	1 464	1 266	0,00	
3,747 % éch. 25/06/2037 ^	6 312	4 383	0,01	3,942 % éch. 25/05/2036	2 724	2 313	0,00	London Wall Mortgage Capital PLC				
3,778 % éch. 25/11/2035 ^	1 444	1 163	0,00	3,954 % éch. 25/05/2036	382	333	0,00	5,502 % éch. 15/05/2052	£ 9 139	11 528	0,02	
3,789 % éch. 25/09/2036 ^	126	106	0,00	4,035 % éch. 25/04/2036	2 914	2 518	0,01	Ludgate Funding PLC				
3,860 % éch. 25/05/2035 ^	58	42	0,00	4,106 % éch. 25/09/2035	353	322	0,00	3,212 % éch. 01/01/2061	€ 2 894	3 018	0,01	
3,987 % éch. 25/09/2037	12 865	9 737	0,02	4,176 % éch. 25/04/2035 ^	306	277	0,00	3,292 % éch. 01/01/2061	792	795	0,00	
4,335 % éch. 25/08/2034	79	71	0,00	4,177 % éch. 25/08/2035	3 058	3 058	0,01	3,362 % éch. 01/01/2061	2 639	2 629	0,01	
5,310 % éch. 25/04/2037	944	820	0,00	4,197 % éch. 25/05/2037	1 418	1 246	0,00	3,752 % éch. 01/01/2061	10 687	11 141	0,02	
5,340 % éch. 25/04/2037	1 588	1 381	0,00	4,274 % éch. 25/06/2034	14	13	0,00	3,764 % éch. 01/12/2060	1 658	1 664	0,00	
5,390 % éch. 25/07/2036	4 540	4 281	0,01	4,288 % éch. 25/10/2037	2 429	1 915	0,00	4,670 % éch. 01/01/2061	£ 5 806	6 819	0,01	
5,400 % éch. 25/09/2037	4 245	3 911	0,01	4,700 % éch. 25/07/2035	271	241	0,00	5,030 % éch. 01/01/2061	3 653	4 446	0,01	
5,410 % éch. 25/10/2036	2 545	2 184	0,00	5,500 % éch. 25/07/2036	2 913	1 574	0,00	5,068 % éch. 01/12/2060	961	1 161	0,00	
5,490 % éch. 25/01/2037 ^	7 984	6 721	0,01	5,750 % éch. 25/01/2036 ^	2 181	485	0,00	5,178 % éch. 01/12/2060	2 163	2 540	0,01	
5,500 % éch. 25/06/2036	2 769	2 161	0,00	6,000 % éch. 25/02/2037	2 646	1 437	0,00	Luminent Mortgage Trust				
5,510 % éch. 25/08/2036	8 134	5 828	0,01	6,000 % éch. 25/03/2037 ^	4 858	2 639	0,01	5,430 % éch. 25/01/2037 ^	\$ 2 367	1 995	0,00	
5,510 % éch. 25/02/2037 ^	5 732	5 102	0,01	6,250 % éch. 25/08/2037	5 086	1 593	0,00	5,490 % éch. 25/12/2036	2 884	2 550	0,01	
5,510 % éch. 25/07/2047	3 364	2 341	0,00	6,500 % éch. 25/01/2035	1 363	1 363	0,00	5,510 % éch. 25/12/2036 ^	95	86	0,00	
5,530 % éch. 25/10/2036	5 079	2 153	0,00	6,500 % éch. 25/07/2036 ^	219	89	0,00	5,530 % éch. 25/05/2046	876	733	0,00	
5,550 % éch. 25/06/2046	5 667	4 534	0,01	6,500 % éch. 25/08/2036	4 390	1 589	0,00	5,550 % éch. 25/02/2046	1 757	1 338	0,00	
5,550 % éch. 25/11/2046	6 400	5 776	0,01	JPMorgan Resecuritization Trust				Madison Avenue Mortgage Trust				
5,570 % éch. 25/11/2036	155	144	0,00	4,500 % éch. 28/04/2037	1 389	679	0,00	3,294 % éch. 15/08/2034	8 074	7 430	0,01	
5,570 % éch. 25/02/2046	5 027	3 740	0,01	4,716 % éch. 28/08/2036	259	225	0,00	Mansard Mortgages PLC				
5,570 % éch. 25/04/2046	2 654	2 386	0,00	5,428 % éch. 28/09/2037	1 292	969	0,00	4,765 % éch. 15/04/2047	£ 1 980	2 423	0,01	
5,570 % éch. 25/05/2046	7 592	6 753	0,01	5,750 % éch. 28/05/2037	127	57	0,00	6,251 % éch. 15/12/2049	3 273	3 971	0,01	
5,590 % éch. 25/04/2046	382	344	0,00	6,000 % éch. 28/09/2036	515	398	0,00	7,001 % éch. 15/12/2049	2 909	3 614	0,01	
5,610 % éch. 25/04/2035	271	237	0,00	Jupiter Mortgage PLC				MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
5,650 % éch. 25/11/2036	3 671	3 590	0,01	5,891 % éch. 20/07/2060	£ 5 900	7 480	0,01	3,234 % éch. 25/02/2035	\$ 159	132	0,00	
5,670 % éch. 25/07/2035	5 781	4 102	0,01	Kinbane DAC				3,352 % éch. 25/03/2035	479	408	0,00	
5,690 % éch. 25/10/2036	2 069	885	0,00	4,263 % éch. 25/09/2062	€ 42 653	46 173	0,07	3,515 % éch. 25/03/2035	100	89	0,00	
5,730 % éch. 25/01/2036	3 007	2 055	0,00	Kirkby RMBS PLC				3,904 % éch. 25/03/2035	51	39	0,00	
5,750 % éch. 25/07/2035	1 092	899	0,00	0,000 % éch. 22/02/2045	£ 1	2 645	0,01	4,267 % éch. 25/09/2034	818	724	0,00	
5,930 % éch. 25/12/2034	780	618	0,00	2,250 % éch. 22/02/2045	4 258	1 085	0,00	6,250 % éch. 25/09/2037	7 382	3 208	0,01	
5,950 % éch. 25/07/2046	4 658	4 090	0,01	5,668 % éch. 22/02/2045	27 490	33 693	0,05	7,480 % éch. 25/12/2035	805	789	0,00	
5,970 % éch. 25/11/2034 ^	1 011	872	0,00	6,868 % éch. 22/02/2045	13 150	15 441	0,03	MASTR Alternative Loan Trust				
6,000 % éch. 25/07/2037 ^	680	501	0,00	Landmark Mortgage Securities PLC				5,500 % éch. 25/04/2035	2 290	2 125	0,00	
6,000 % éch. 25/08/2037 ^	195	81	0,00	3,767 % éch. 17/06/2038	€ 12	13	0,00	5,750 % éch. 25/08/2035 ^	1 341	727	0,00	
6,000 % éch. 25/08/2037	782	333	0,00	5,222 % éch. 17/06/2039	£ 5 590	6 838	0,01	6,500 % éch. 25/05/2034	64	61	0,00	
6,010 % éch. 25/09/2034	44	37	0,00	5,242 % éch. 17/06/2038	21	27	0,00	MASTR Asset Securitization Trust				
6,500 % éch. 25/07/2037 ^	370	123	0,00	Lanebrook Mortgage Transaction PLC				5,000 % éch. 25/07/2019	0	0	0,00	
6,500 % éch. 25/09/2037 ^	1 783	1 086	0,00	5,965 % éch. 12/06/2057	15 511	19 750	0,03	6,000 % éch. 25/06/2036 ^	164	107	0,00	
6,500 % éch. 25/10/2037	2 701	1 469	0,00	Lansdowne Mortgage Securities PLC				6,000 % éch. 25/06/2036 ^	1 600	1 066	0,00	
JPMorgan Alternative Loan Trust				3,826 % éch. 15/06/2045	€ 3 155	3 234	0,01	6,000 % éch. 25/10/2036	661	581	0,00	
3,357 % éch. 25/10/2036	4 369	3 713	0,01	Legacy Mortgage Asset Trust				MASTR Reperforming Loan Trust				
3,841 % éch. 25/03/2036	681	510	0,00	0,000 % éch. 25/12/2056				5,510 % éch. 25/07/2035 ^	3 009	1 467	0,00	
3,881 % éch. 25/01/2036	365	240	0,00	(a)	\$ 117 856	835	0,00	7,000 % éch. 25/08/2034	10	7	0,00	
3,941 % éch. 25/03/2037 ^	958	869	0,00	0,125 % éch. 26/12/2057	(a)	69 561	333	0,00	MASTR Seasoned Securitization Trust			
5,470 % éch. 25/07/2036	2 677	2 368	0,00	1,323 % éch. 26/12/2057	(a)	20 396	230	0,00	5,550 % éch. 25/10/2032	139	123	0,00
5,510 % éch. 25/05/2036	2 832	2 411	0,00	3,017 % éch. 25/12/2056	117 271	94 696	0,15	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				
5,710 % éch. 25/06/2037	17 935	7 461	0,01	4,000 % éch. 25/02/2058	2 226	2 181	0,00	5,673 % éch. 15/06/2030	4	3	0,00	
5,710 % éch. 25/04/2047	3 308	3 114	0,01	4,000 % éch. 25/02/2058	2 226	2 181	0,00	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				
5,843 % éch. 26/05/2037	2 729	2 062	0,00	4,000 % éch. 26/08/2058	11 467	11 355	0,02	4,011 % éch. 25/06/2037 ^	2 551	1 478	0,00	
6,000 % éch. 27/12/2036	1 114	617	0,00	4,218 % éch. 25/02/2058	1 575	1 052	0,00	5,570 % éch. 25/04/2037	11 913	2 430	0,00	
6,180 % éch. 25/03/2036	6 851	5 855	0,01	4,240 % éch. 25/01/2058	21 926	19 132	0,03	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				

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
4,674 % éch. 25/12/2035	\$ 24	\$ 22	0,00	5,165 % éch. 15/12/2050	€ 9 190	\$ 11 034	0,02	5,091 % éch. 25/11/2037	\$ 446	\$ 372	0,00
4,674 % éch. 25/12/2035	1 909	1 821	0,00	6,005 % éch. 15/12/2050	2 640	3 221	0,01	5,336 % éch. 25/09/2045	428	384	0,00
5,610 % éch. 25/04/2029	425	393	0,00	6,255 % éch. 15/12/2050	421	493	0,00	5,350 % éch. 25/05/2037	100	88	0,00
5,810 % éch. 25/06/2028	0	0	0,00	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				5,400 % éch. 25/03/2037 ^	2 069	1 472	0,00
5,810 % éch. 25/09/2029	13	12	0,00	4,680 % éch. 25/06/2036	\$ 272	206	0,00	5,450 % éch. 25/08/2035	145	110	0,00
5,870 % éch. 25/08/2035	2 952	2 732	0,01	5,034 % éch. 25/05/2035	1 587	812	0,00	5,450 % éch. 25/12/2036	3 374	2 360	0,00
5,975 % éch. 25/11/2029	666	580	0,00	5,400 % éch. 25/06/2037	613	530	0,00	5,450 % éch. 25/06/2037 ^	1 020	907	0,00
5,997 % éch. 25/09/2029	105	97	0,00	5,669 % éch. 25/03/2047	821	731	0,00	5,450 % éch. 25/02/2047	1 474	1 296	0,00
6,095 % éch. 25/08/2036	1 810	1 611	0,00	5,670 % éch. 25/12/2035	775	717	0,00	5,470 % éch. 25/01/2037	4 671	4 045	0,01
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust				5,688 % éch. 25/07/2035	461	441	0,00	5,476 % éch. 25/08/2035	1 594	1 316	0,00
7,620 % éch. 25/08/2036 ^	1 605	1 422	0,00	5,995 % éch. 25/03/2047	1 510	1 344	0,00	5,490 % éch. 25/12/2036	2 347	2 242	0,00
Mettlife Securitization Trust				6,150 % éch. 25/05/2035	1 292	1 044	0,00	5,490 % éch. 25/01/2037	1 946	1 604	0,00
3,750 % éch. 25/03/2057	5 018	4 702	0,01	6,170 % éch. 25/08/2034	349	324	0,00	5,500 % éch. 25/06/2035 ^	911	750	0,00
Miravet SARL				6,408 % éch. 25/05/2036 ^	732	165	0,00	5,500 % éch. 25/09/2035 ^	1 395	1 135	0,00
4,265 % éch. 26/05/2065	€ 34 623	37 192	0,06	6,772 % éch. 25/02/2036 ^	35	30	0,00	5,500 % éch. 25/02/2036	571	453	0,00
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust				Nomura Resecuritization Trust				5,500 % éch. 25/12/2036	2 059	1 432	0,00
1,063 % éch. 15/02/2047				1,893 % éch. 26/03/2037	2 382	1 946	0,00	5,510 % éch. 25/07/2036	985	853	0,00
(a)	\$ 3 767	5	0,00	6,050 % éch. 25/07/2036	21 897	20 752	0,03	5,510 % éch. 25/07/2036 ^	5 771	2 418	0,00
3,046 % éch. 15/04/2048	40 000	38 013	0,06	NovaStar Mortgage Funding Trust				5,510 % éch. 25/01/2037 ^	1 909	1 271	0,00
Morgan Stanley Capital Trust				0,440 % éch. 25/09/2046	11 514	4 030	0,01	5,530 % éch. 25/07/2036	1 282	1 112	0,00
7,143 % éch. 15/07/2035	34 709	33 910	0,05	OBX Trust				5,530 % éch. 25/09/2036 ^	1 765	1 631	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				5,800 % éch. 25/06/2057	1 853	1 758	0,00	5,530 % éch. 25/12/2036	1 423	1 245	0,00
2,120 % éch. 25/06/2037	3 848	2 022	0,00	6,000 % éch. 25/04/2048	482	478	0,00	5,530 % éch. 25/07/2037	4 123	3 788	0,01
3,103 % éch. 25/11/2037	6 533	4 327	0,01	Paragon Mortgages PLC				5,530 % éch. 25/05/2047	923	821	0,00
3,108 % éch. 25/11/2037 ^	91	59	0,00	7,752 % éch. 15/08/2045	5 383	6 848	0,01	5,550 % éch. 25/08/2036 ^	146	108	0,00
4,148 % éch. 25/03/2036 ^	39	25	0,00	Pepper Residential Securities Trust				5,550 % éch. 25/05/2037 ^	3 019	2 132	0,00
4,183 % éch. 25/10/2037	661	451	0,00	6,057 % éch. 18/11/2060	\$ 1 886	1 885	0,00	5,580 % éch. 25/05/2046	2 997	2 602	0,01
4,271 % éch. 25/05/2036 ^	1 728	1 015	0,00	PHH Alternative Mortgage Trust				5,690 % éch. 25/02/2046 ^	72	46	0,00
4,614 % éch. 25/08/2034	25	23	0,00	5,470 % éch. 25/02/2037	4 170	3 137	0,01	5,750 % éch. 25/05/2046 ^	2 701	2 156	0,00
5,470 % éch. 25/06/2036	3 592	757	0,00	5,630 % éch. 25/05/2037	2 025	1 859	0,00	5,750 % éch. 25/01/2037	1 531	1 154	0,00
5,490 % éch. 25/08/2036	5 913	1 772	0,00	5,850 % éch. 25/07/2037	902	864	0,00	5,750 % éch. 25/03/2037 ^	4 563	3 401	0,01
5,500 % éch. 25/10/2037 ^	312	288	0,00	Pierpont BTL PLC				6,000 % éch. 25/09/2035 ^	2 092	1 824	0,00
5,560 % éch. 25/02/2047	7 306	3 065	0,01	0,000 % éch. 21/09/2054	€ 9 850	12 493	0,02	6,000 % éch. 25/12/2035	966	869	0,00
5,750 % éch. 25/02/2036 ^	468	410	0,00	Polaris PLC				6,000 % éch. 25/04/2036	1 013	816	0,00
6,000 % éch. 25/12/2035	2 598	1 081	0,00	5,631 % éch. 23/12/2058	3 631	4 595	0,01	6,000 % éch. 25/05/2036 ^	464	362	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036 ^	2 305	1 585	0,00	6,154 % éch. 27/05/2057	13 721	17 537	0,03	6,000 % éch. 25/06/2036 ^	2 423	1 933	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036	1 211	567	0,00	7,490 % éch. 23/05/2059	2 768	3 544	0,01	6,000 % éch. 25/06/2036 ^	214	166	0,00
6,000 % éch. 25/10/2037 ^	2 943	1 774	0,00	Precise Mortgage Funding PLC				6,000 % éch. 25/07/2036 ^	278	213	0,00
6,000 % éch. 25/10/2037	7 806	4 235	0,01	0,000 % éch. 12/12/2055				6,000 % éch. 25/08/2036 ^	125	100	0,00
6,115 % éch. 25/06/2036	1 086	1 068	0,00	(f)	0	6 776	0,01	6,000 % éch. 25/09/2036 ^	4 948	4 039	0,01
6,275 % éch. 25/09/2035	2 124	2 045	0,00	5,657 % éch. 16/10/2056	10 057	12 769	0,02	6,000 % éch. 25/09/2036 ^	882	666	0,00
6,354 % éch. 25/08/2036 ^	1 277	255	0,00	6,004 % éch. 12/03/2055	3 983	5 069	0,01	6,000 % éch. 25/11/2036 ^	183	143	0,00
6,500 % éch. 25/02/2036 ^	100	46	0,00	6,177 % éch. 16/10/2056	1 200	1 517	0,00	6,000 % éch. 25/01/2037	435	333	0,00
6,875 % éch. 25/11/2035	1 855	1 765	0,00	6,427 % éch. 16/10/2056	1 000	1 261	0,00	6,000 % éch. 25/01/2037 ^	3 422	2 649	0,01
7,130 % éch. 25/09/2035	990	990	0,00	6,677 % éch. 16/10/2056	1 000	1 246	0,00	6,000 % éch. 25/03/2037 ^	415	342	0,00
Morgan Stanley Re-REMIC Trust				7,827 % éch. 16/10/2056	1 000	1 234	0,00	6,000 % éch. 25/04/2037 ^	352	274	0,00
3,768 % éch. 26/12/2036	2 461	2 120	0,00	Prime Mortgage Trust				6,000 % éch. 25/05/2037 ^	309	250	0,00
Morgan Stanley Resecuritization Trust				6,000 % éch. 25/06/2036 ^	\$ 9	9	0,00	6,000 % éch. 25/06/2037 ^	443	345	0,00
3,644 % éch. 26/06/2047	5 669	4 484	0,01	Primrose Residential DAC				6,108 % éch. 25/02/2036 ^	1 906	1 540	0,00
3,693 % éch. 26/11/2046	3 074	2 628	0,01	4,189 % éch. 24/03/2061	€ 3 845	4 167	0,01	6,250 % éch. 25/01/2037 ^	113	92	0,00
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				4,439 % éch. 24/10/2061	30 249	32 690	0,05	6,500 % éch. 25/04/2036 ^	2 769	2 264	0,00
5,720 % éch. 25/02/2042	5 896	5 694	0,01	Proteus RBMS DAC				6,500 % éch. 25/11/2036 ^	480	242	0,00
Mortgage Funding PLC				0,000 % éch. 29/10/2054				6,500 % éch. 25/02/2037	234	186	0,00
6,090 % éch. 13/03/2046	€ 7 619	9 619	0,02	(b)(f)	13 990	12 417	0,02	6,750 % éch. 25/06/2037	4 729	3 928	0,01
MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust				0,000 % éch. 29/10/2054	200	0	0,00	Residential Asset Securitization Trust			
5,610 % éch. 25/06/2047	\$ 8 151	6 629	0,01	4,150 % éch. 29/10/2054	47 658	52 344	0,08	5,500 % éch. 25/08/2034	820	788	0,00
5,650 % éch. 25/09/2037	3 379	2 932	0,01	4,600 % éch. 29/10/2054	8 681	9 443	0,02	5,500 % éch. 25/09/2035	2 630	1 355	0,00
MortgageIT Trust				4,900 % éch. 29/10/2054	6 313	6 867	0,01	5,500 % éch. 25/11/2035 ^	117	57	0,00
5,710 % éch. 25/10/2035	138	135	0,00	5,880 % éch. 29/10/2054	4 735	5 181	0,01	5,750 % éch. 25/02/2036	1 314	1 213	0,00
5,750 % éch. 25/08/2035	1 653	1 573	0,00	7,750 % éch. 29/10/2054	3 346	4 335	0,01	6,000 % éch. 25/07/2035 ^	1 356	928	0,00
5,770 % éch. 25/12/2035	1 614	1 536	0,00	RBSCG Mortgage Loan Trust				6,000 % éch. 25/02/2036	17 182	7 777	0,01
6,035 % éch. 25/02/2035	350	328	0,00	5,600 % éch. 25/01/2037 ^	\$ 530	175	0,00	6,000 % éch. 25/04/2036 ^	430	190	0,00
6,420 % éch. 25/02/2035	2	2	0,00	RBSCG Structured Trust				6,000 % éch. 25/04/2036 ^	2 456	1 203	0,00
MSDB Trust				5,500 % éch. 25/11/2035 ^	65	54	0,00	6,000 % éch. 25/06/2036	3 965	1 733	0,00
3,427 % éch. 11/07/2039	1 600	1 364	0,00	RBSSP Resecuritization Trust				6,000 % éch. 25/09/2036 ^	7 160	2 373	0,00
MSSG Trust				3,514 % éch. 26/01/2036	5 097	4 550	0,01	6,000 % éch. 25/12/2036 ^	9 900	3 146	0,01
3,397 % éch. 13/09/2039	9 550	8 071	0,01	3,768 % éch. 26/12/2036	3 143	2 966	0,01	6,000 % éch. 25/04/2037 ^	587	342	0,00
New Century Alternative Mortgage Loan Trust				5,378 % éch. 27/06/2036	2 100	1 662	0,00	6,000 % éch. 25/07/2037 ^	500	284	0,00
4,654 % éch. 25/10/2036 ^	6 260	1 292	0,00	6,000 % éch. 26/05/2036	1 499	666	0,00	6,000 % éch. 25/08/2037	1 077	467	0,00
6,810 % éch. 25/07/2036	3 271	783	0,00	6,000 % éch. 26/08/2037	567	472	0,00	6,000 % éch. 25/01/2046	2 324	1 328	0,00
New Century Home Equity Loan Trust				12,418 % éch. 26/10/2037	2 098	1 816	0,00	6,250 % éch. 25/08/2036	1 504	650	0,00
3,750 % éch. 25/08/2055	4 779	4 425	0,01	Residential Accredit Loans, Inc. Trust				6,000 % éch. 25/01/2046 ^	870	378	0,00
New Residential Mortgage Loan Trust				1,400 % éch. 25/12/2036				6,250 % éch. 25/12/2036 ^	1 234	856	0,00
4,500 % éch. 25/05/2058	16 288	15 555	0,03	(a)	1 930	206	0,00	6,250 % éch. 25/07/2036	2 011	751	0,00
Newgate Funding PLC				1,490 % éch. 25/01/2037				6,500 % éch. 25/09/2036 ^	1 076	333	0,00
3,420 % éch. 01/12/2050	€ 4 664	4 852	0,01	(a)	1 919						

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
3,860 % éch. 25/06/2035	\$ 251	\$ 143	0,00	4,348 % éch. 25/11/2035	\$ 48	\$ 35	0,00	5,891 % éch. 20/10/2051	£ 4 000	\$ 5 019	0,01
4,112 % éch. 25/04/2037	145	84	0,00	4,472 % éch. 25/05/2036	855	636	0,00	6,097 % éch. 20/05/2045	51 349	65 094	0,10
4,115 % éch. 25/09/2036 ^	89	46	0,00	4,508 % éch. 25/11/2037 ^	324	271	0,00	6,216 % éch. 20/02/2045	15 162	19 242	0,03
4,149 % éch. 25/09/2035 ^	2 159	1 397	0,00	4,556 % éch. 25/11/2037 ^	200	141	0,00	6,541 % éch. 20/10/2051 ^	13 500	16 776	0,03
4,500 % éch. 25/10/2018	13	5	0,00	4,892 % éch. 25/01/2035	204	189	0,00	6,546 % éch. 20/02/2054	34 671	44 091	0,07
4,573 % éch. 25/04/2037	87	69	0,00	5,227 % éch. 25/09/2034	2	2	0,00	6,991 % éch. 20/10/2051	4 500	5 567	0,01
4,573 % éch. 25/04/2037 ^	340	263	0,00	5,348 % éch. 25/04/2036	322	269	0,00	Towd Point Mortgage Trust			
4,978 % éch. 27/07/2037 ^	399	329	0,00	5,375 % éch. 25/02/2035	2 648	2 528	0,01	2,750 % éch. 25/06/2057	\$ 6 150	5 802	0,01
5,224 % éch. 25/08/2036 ^	1 150	807	0,00	5,450 % éch. 25/09/2034	311	279	0,00	2,750 % éch. 25/10/2055	10 062	9 555	0,02
6,000 % éch. 25/06/2036 ^	263	219	0,00	5,462 % éch. 25/01/2035	49	45	0,00	3,750 % éch. 25/04/2055	6 605	6 236	0,01
6,000 % éch. 25/07/2036 ^	190	158	0,00	5,470 % éch. 25/01/2037	2 009	1 725	0,00	Tower Bridge Funding PLC			
6,000 % éch. 25/09/2036	758	569	0,00	5,570 % éch. 25/10/2035	1 999	1 831	0,00	5,629 % éch. 20/12/2063	£ 3 906	4 944	0,01
6,250 % éch. 25/08/2036	1 269	1 056	0,00	5,590 % éch. 25/05/2037	781	688	0,00	5,847 % éch. 20/11/2063	1 500	1 879	0,00
Residential Mortgage Securities PLC				5,630 % éch. 25/05/2037 ^	1 423	1 244	0,00	Trinidad Mortgage Securities PLC			
6,159 % éch. 20/06/2070	£ 10 820	13 799	0,02	5,700 % éch. 25/09/2034	4 336	3 747	0,01	5,443 % éch. 24/01/2059	1 930	2 453	0,00
6,809 % éch. 20/06/2070	1 355	1 723	0,00	5,773 % éch. 25/10/2035 ^	88	78	0,00	Trinity Square PLC			
RESIMAC Bastille Trust				6,063 % éch. 25/12/2034	17	17	0,00	5,866 % éch. 15/07/2059	34 300	43 367	0,07
5,190 % éch. 05/09/2057	AUD 11 771	7 835	0,01	6,125 % éch. 25/08/2035	1 736	1 538	0,00	6,166 % éch. 15/07/2059	12 400	15 629	0,03
RESIMAC Premier				Structured Asset Mortgage Investments Trust				6,466 % éch. 15/07/2059	9 600	11 986	0,02
5,350 % éch. 07/02/2052	5 758	3 836	0,01	3,363 % éch. 19/10/2034	295	247	0,00	7,216 % éch. 15/07/2059	5 700	7 110	0,01
6,241 % éch. 07/02/2052	\$ 1 675	1 674	0,00	3,547 % éch. 25/05/2047 ^	3 128	2 574	0,01	Tudor Rose Mortgages			
Resloc UK PLC				3,992 % éch. 27/12/2035 ^	43	42	0,00	5,509 % éch. 20/06/2048	6 744	8 527	0,01
5,221 % éch. 15/12/2043	£ 2 380	2 851	0,01	5,270 % éch. 25/08/2036	9 279	8 057	0,01	Twin Bridges PLC			
5,250 % éch. 15/12/2043	\$ 11 861	11 209	0,02	5,270 % éch. 25/10/2036	4 015	3 529	0,01	0,000 % éch. 14/06/2055	38 700	49 050	0,08
Ripon Mortgages PLC				5,320 % éch. 25/02/2036	2 057	1 713	0,00	6,115 % éch. 12/12/2054	23 543	29 994	0,05
5,491 % éch. 28/08/2056	£ 466 608	591 116	0,92	5,330 % éch. 25/01/2037	2 095	1 861	0,00	6,865 % éch. 12/06/2055	5 819	7 401	0,01
River Green Finance DAC				5,330 % éch. 25/09/2047	194	176	0,00	Uropa Securities PLC			
3,911 % éch. 22/01/2032	€ 13 255	13 926	0,02	5,370 % éch. 25/09/2047	9 558	7 974	0,01	3,255 % éch. 10/10/2040	€ 6 136	6 433	0,01
RiverView HECM Trust				5,376 % éch. 25/12/2035 ^	1 285	1 044	0,00	4,879 % éch. 10/10/2040	£ 6 899	8 287	0,01
5,420 % éch. 25/05/2047	\$ 4 329	4 116	0,01	5,470 % éch. 25/01/2037	3 222	2 845	0,01	Verus Securitization Trust			
RMAC Securities PLC				5,510 % éch. 25/07/2046	4 040	3 363	0,01	1,977 % éch. 25/03/2060	\$ 439	428	0,00
3,636 % éch. 12/06/2044	€ 1 850	1 938	0,00	5,550 % éch. 25/02/2036	312	246	0,00	3,035 % éch. 25/03/2060	700	666	0,00
3,726 % éch. 12/06/2044	5 884	6 021	0,01	5,570 % éch. 25/05/2036	2 498	1 684	0,00	3,889 % éch. 25/03/2060	1 000	942	0,00
3,756 % éch. 12/06/2044	1 736	1 770	0,00	5,570 % éch. 25/09/2047 ^	13 432	11 125	0,02	Wachovia Mortgage Loan Trust			
3,956 % éch. 12/06/2044	5 852	5 945	0,01	5,590 % éch. 25/05/2036	10 208	8 186	0,01	1,560 % éch. 25/01/2037	2 082	800	0,00
5,134 % éch. 12/06/2044	£ 1 652	2 015	0,00	5,610 % éch. 25/02/2036 ^	1 221	1 066	0,00	1,679 % éch. 25/08/2036	1 309	468	0,00
5,154 % éch. 12/06/2044	21 728	26 432	0,04	5,610 % éch. 25/05/2045	54	49	0,00	Wachovia Mortgage Loan Trust LLC			
5,414 % éch. 12/06/2044	753	901	0,00	5,628 % éch. 19/04/2035	3	3	0,00	4,291 % éch. 20/10/2035 ^	218	205	0,00
5,502 % éch. 12/06/2044	\$ 292	280	0,00	5,646 % éch. 19/07/2035	36	33	0,00	4,654 % éch. 20/08/2035 ^	138	132	0,00
5,814 % éch. 12/06/2044	£ 1 426	1 630	0,00	5,700 % éch. 25/09/2047 ^	5 275	4 332	0,01	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
Rochester Financing PLC				5,710 % éch. 25/02/2036 ^	79	67	0,00	3,053 % éch. 25/01/2037 ^	797	667	0,00
5,602 % éch. 18/12/2044	2 308	2 900	0,01	5,746 % éch. 19/07/2034	508	455	0,00	3,307 % éch. 25/01/2037 ^	2 688	2 363	0,00
Roundstone Securities DAC				5,750 % éch. 25/08/2036 ^	6 458	4 585	0,01	3,342 % éch. 25/11/2036 ^	3 085	2 655	0,01
0,000 % éch. 28/09/2055	€ 19 776	17 901	0,03	5,846 % éch. 19/12/2034	129	115	0,00	3,435 % éch. 25/12/2036 ^	665	581	0,00
1,000 % éch. 28/09/2055	3 941	3 995	0,01	6,271 % éch. 19/12/2033	352	321	0,00	3,472 % éch. 25/03/2037 ^	985	784	0,00
4,177 % éch. 28/09/2055	114 649	124 810	0,19	Structured Asset Securities Corp.				3,528 % éch. 25/12/2036 ^	6 304	5 546	0,01
4,327 % éch. 28/09/2055	15 538	16 864	0,03	5,400 % éch. 25/07/2035	1 791	1 626	0,00	3,626 % éch. 25/09/2036	4 019	3 490	0,01
4,577 % éch. 28/09/2055	10 594	11 481	0,02	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				3,630 % éch. 25/09/2036 ^	114	93	0,00
5,077 % éch. 28/09/2055	6 356	6 876	0,01	5,400 % éch. 25/05/2036	1 986	1 601	0,00	3,633 % éch. 25/12/2036	506	438	0,00
5,827 % éch. 28/09/2055	10 594	11 408	0,02	SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				3,633 % éch. 25/12/2036 ^	208	180	0,00
Sequoia Mortgage Trust				3,732 % éch. 25/10/2037 ^	626	552	0,00	3,651 % éch. 25/02/2037 ^	1 466	1 273	0,00
3,723 % éch. 20/07/2037	\$ 1 460	1 180	0,00	4,167 % éch. 25/06/2037	1 023	939	0,00	3,669 % éch. 25/02/2037 ^	3 835	3 469	0,01
4,015 % éch. 20/06/2037 ^	3 345	2 735	0,01	TBW Mortgage-Backed Trust				3,693 % éch. 25/08/2046 ^	912	819	0,00
5,477 % éch. 20/11/2034	656	604	0,00	5,500 % éch. 25/07/2036 ^	10	1	0,00	3,753 % éch. 25/02/2037 ^	8 415	7 699	0,01
5,708 % éch. 20/02/2034	240	214	0,00	5,965 % éch. 25/07/2037	3 683	1 177	0,00	3,772 % éch. 25/02/2037 ^	1 716	1 540	0,00
Sestante Finance SRL				6,450 % éch. 25/03/2037	13 360	3 242	0,01	3,781 % éch. 25/08/2046 ^	186	162	0,00
3,431 % éch. 23/07/2046	€ 15 709	16 223	0,03	TDA Mixto Fondo de Titulizacion de Activos				3,781 % éch. 25/08/2046 ^	285	254	0,00
Shamrock Residential DAC				3,767 % éch. 22/06/2040	€ 6 051	6 083	0,01	3,784 % éch. 25/06/2037 ^	1 515	1 331	0,00
4,289 % éch. 24/12/2059	25 205	27 231	0,04	Temple Quay PLC				3,809 % éch. 25/07/2037 ^	4 569	4 219	0,01
4,289 % éch. 24/01/2061	43 992	47 491	0,07	6,524 % éch. 24/07/2085	£ 15 905	19 977	0,03	3,816 % éch. 25/10/2036 ^	2 700	2 448	0,00
4,439 % éch. 24/06/2071	30 157	32 573	0,05	7,524 % éch. 24/07/2085	14 681	18 443	0,03	3,816 % éch. 25/10/2036	1 437	1 303	0,00
4,689 % éch. 24/02/2071	43 377	47 055	0,07	Terwin Mortgage Trust				3,823 % éch. 27/02/2034	8	7	0,00
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				4,124 % éch. 25/10/2037	\$ 5 309	1 971	0,00	3,824 % éch. 25/06/2037 ^	1 305	1 157	0,00
5,221 % éch. 20/01/2054	£ 23 789	30 088	0,05	Tharaldson Hotel Portfolio Trust				3,894 % éch. 25/05/2037 ^	1 139	949	0,00
Stratton Hawksmoor PLC				6,591 % éch. 11/11/2034	27 138	26 715	0,04	3,900 % éch. 25/12/2035	5 435	5 144	0,01
6,266 % éch. 25/02/2053	63 113	79 524	0,12	6,841 % éch. 11/11/2034	13 609	13 296	0,02	3,913 % éch. 25/04/2035	1 426	1 352	0,00
6,516 % éch. 25/02/2053	37 882	47 096	0,07	7,491 % éch. 11/11/2034	25 064	24 306	0,04	3,923 % éch. 25/05/2037	1 403	1 189	0,00
6,766 % éch. 25/02/2053	29 847	36 476	0,06	Thornburg Mortgage Securities Trust				4,003 % éch. 25/06/2037 ^	941	856	0,00
Stratton Mortgage Funding PLC				2,553 % éch. 25/03/2044	686	668	0,00	4,008 % éch. 25/12/2046 ^	5 187	4 443	0,01
5,391 % éch. 20/07/2060	96 944	123 261	0,19	3,002 % éch. 25/04/2036	927	841	0,00	4,008 % éch. 25/12/2046	1 877	1 667	0,00
5,765 % éch. 12/03/2052	12 568	15 923	0,03	3,018 % éch. 25/09/2037	464	452	0,00	4,029 % éch. 25/08/2036 ^	172	144	0,00
5,792 % éch. 25/09/2051	28 847	36 590	0,06	3,114 % éch. 25/09/2037	1 167	1 134	0,00	4,029 % éch. 25/08/2036 ^	642	550	0,00
5,991 % éch. 20/07/2060	9 236	11 692	0,02	3,442 % éch. 25/10/2046	47	44	0,00	4,079 % éch. 25/03/2035	2 002	1 940	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				3,889 % éch. 25/07/2036	1 375	1 139	0,00	4,081 % éch. 25/07/2037 ^	3 734	3 489	0,01
3,663 % éch. 25/10/2036	\$ 2 095	1 881	0,0								

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
Bastille Euro CLO DAC	€ 20 000	\$ 21 258	0,03	5,870 % éch. 25/01/2035	\$ 1 305	\$ 1 292	0,00	3,820 % éch. 25/12/2034	\$ 929	\$ 913	0,00
4,327 % éch. 15/01/2034				5,900 % éch. 25/01/2035	1 492	1 449	0,00	3,903 % éch. 25/01/2037	6 842	6 657	0,01
Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust				6,060 % éch. 25/09/2034	666	638	0,00	4,033 % éch. 25/01/2037	13 000	11 904	0,02
6,048 % éch. 28/04/2036	\$ 1 237	1 201	0,00	6,065 % éch. 25/10/2035	6	6	0,00	4,225 % éch. 25/05/2036	24 922	24 000	0,04
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				6,080 % éch. 25/09/2034	203	196	0,00	4,342 % éch. 25/10/2046 ^	8 315	8 053	0,01
4,037 % éch. 25/07/2036	57	54	0,00	6,110 % éch. 25/03/2035	3 157	2 984	0,01	4,350 % éch. 25/11/2034	8 388	8 025	0,01
4,477 % éch. 25/11/2035 ^	1 863	1 748	0,00	Chase Funding Trust		0	0,00	4,380 % éch. 25/01/2035	2 085	1 646	0,00
4,655 % éch. 25/10/2036	53	52	0,00	5,900 % éch. 25/09/2033	0	0	0,00	4,473 % éch. 25/07/2036	4 624	4 133	0,01
4,655 % éch. 25/10/2036	50	47	0,00	CIT Mortgage Loan Trust				5,115 % éch. 25/10/2035	1 250	1 072	0,00
4,705 % éch. 25/12/2035	121	121	0,00	6,500 % éch. 25/10/2037	2 357	2 353	0,00	5,290 % éch. 25/06/2035	13 401	11 677	0,02
4,993 % éch. 25/12/2035	2 334	2 009	0,00	6,650 % éch. 25/10/2037	71 896	69 992	0,11	5,290 % éch. 25/05/2037	5 991	5 522	0,01
4,998 % éch. 25/09/2034	1 407	1 371	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust				5,290 % éch. 25/06/2037	12 534	11 569	0,02
4,998 % éch. 25/09/2034	91	82	0,00	4,277 % éch. 25/10/2037	421	384	0,00	5,290 % éch. 25/07/2037 ^	627	617	0,00
5,082 % éch. 25/11/2034	375	370	0,00	5,220 % éch. 25/05/2037	1 964	1 289	0,00	5,290 % éch. 25/07/2037	3 051	2 772	0,01
5,085 % éch. 25/04/2036	1 885	1 873	0,00	5,290 % éch. 25/01/2037	10 152	9 201	0,02	5,290 % éch. 25/08/2037	92	91	0,00
5,087 % éch. 25/08/2034	452	421	0,00	5,325 % éch. 25/05/2037	347	328	0,00	5,290 % éch. 25/09/2037 ^	1 931	1 699	0,00
5,161 % éch. 25/01/2035	2 578	2 503	0,00	5,330 % éch. 25/01/2037	14 058	10 316	0,02	5,290 % éch. 25/04/2047	2 180	2 075	0,00
5,290 % éch. 25/03/2037	2 075	1 860	0,00	5,350 % éch. 25/05/2037	4 273	2 819	0,01	5,290 % éch. 25/06/2047 ^	1 370	1 221	0,00
5,310 % éch. 25/01/2037	7 337	7 274	0,01	5,420 % éch. 25/07/2045	4 224	2 955	0,01	5,290 % éch. 25/06/2047	1 153	1 060	0,00
5,380 % éch. 25/02/2037	1 500	1 364	0,00	5,420 % éch. 25/05/2037	25 116	22 951	0,04	5,300 % éch. 25/04/2047 ^	87	85	0,00
5,400 % éch. 25/04/2037 ^	1 639	2 320	0,00	5,430 % éch. 25/12/2036	3 545	3 353	0,01	5,320 % éch. 25/06/2047	16 333	15 549	0,02
5,430 % éch. 25/11/2036	513	497	0,00	5,440 % éch. 25/09/2036	5 939	5 616	0,01	5,330 % éch. 25/06/2047	470	439	0,00
5,450 % éch. 25/06/2047	161	154	0,00	5,450 % éch. 25/12/2036	944	381	0,00	5,330 % éch. 25/11/2047 ^	1 816	2 004	0,00
5,490 % éch. 25/05/2035	11	11	0,00	5,470 % éch. 25/09/2036	1 422	1 039	0,00	5,340 % éch. 25/11/2037	8 528	7 839	0,01
5,490 % éch. 25/12/2036	9 843	9 354	0,02	5,470 % éch. 25/12/2036	17 972	10 103	0,02	5,348 % éch. 25/02/2036	7 000	5 925	0,01
5,500 % éch. 25/06/2047	7 641	6 414	0,01	5,550 % éch. 25/11/2046	4 689	4 496	0,01	5,350 % éch. 25/06/2047 ^	9 966	8 625	0,01
5,510 % éch. 25/10/2036	925	914	0,00	5,570 % éch. 25/12/2036	3 787	3 698	0,01	5,360 % éch. 25/05/2047 ^	6 632	5 769	0,01
5,527 % éch. 25/02/2034	249	245	0,00	5,570 % éch. 25/01/2037	2 382	2 326	0,00	5,370 % éch. 25/05/2037	6 436	6 114	0,01
5,600 % éch. 25/01/2047	2 137	2 041	0,00	5,600 % éch. 25/01/2037	434	399	0,00	5,370 % éch. 25/08/2037	15 067	13 991	0,02
5,650 % éch. 25/08/2036	5 489	4 949	0,01	5,630 % éch. 25/08/2036	3 018	2 654	0,00	5,370 % éch. 25/09/2037 ^	9 518	9 547	0,02
5,650 % éch. 25/05/2037	2 241	2 105	0,00	5,650 % éch. 25/08/2036	494	479	0,00	5,370 % éch. 25/06/2047	11 617	11 038	0,02
5,670 % éch. 25/09/2036 ^	2 206	1 900	0,00	5,670 % éch. 25/03/2036	3 876	3 462	0,01	5,370 % éch. 25/06/2047 ^	10 690	9 661	0,02
5,885 % éch. 25/09/2035	155	154	0,00	5,750 % éch. 25/12/2035 ^	1 747	1 653	0,00	5,380 % éch. 25/05/2037	9 305	8 634	0,01
6,155 % éch. 25/06/2035	3 578	3 426	0,01	5,775 % éch. 25/10/2036	995	654	0,00	5,380 % éch. 25/07/2037 ^	18 023	15 027	0,02
6,170 % éch. 25/10/2035	1 813	1 767	0,00	6,352 % éch. 25/05/2036 ^	1 028	412	0,00	5,380 % éch. 25/10/2047	5 296	5 195	0,01
6,200 % éch. 25/08/2037	10 565	8 867	0,01	6,851 % éch. 25/05/2036 ^	518	207	0,00	5,400 % éch. 25/06/2047	11 973	11 506	0,02
6,275 % éch. 25/02/2035	745	741	0,00	7,250 % éch. 25/05/2036	11 910	6 345	0,01	5,410 % éch. 25/12/2036 ^	7 794	6 982	0,01
6,350 % éch. 25/06/2036	616	596	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through				5,410 % éch. 25/04/2046	843	776	0,00
6,500 % éch. 25/10/2036 ^	2 297	1 035	0,00	Certificates				5,410 % éch. 25/06/2047	6 724	5 256	0,01
7,100 % éch. 25/11/2039	944	949	0,00	6,155 % éch. 25/10/2034	3 643	3 169	0,01	5,410 % éch. 25/06/2047 ^	5 544	4 366	0,01
8,300 % éch. 25/12/2042	1 522	1 620	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				5,430 % éch. 25/02/2037	518	489	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				5,410 % éch. 25/03/2037	5 597	4 739	0,01	5,505 % éch. 25/07/2035	442	399	0,00
7,150 % éch. 25/03/2037	2 151	1 980	0,00	5,500 % éch. 25/03/2037	1 983	1 636	0,00	5,555 % éch. 25/07/2035	3 355	3 119	0,01
Blackrock European CLO DAC	€ 8 978	9 659	0,02	5,585 % éch. 25/11/2036	4 469	4 354	0,01	5,585 % éch. 25/01/2045 ^	2 700	2 402	0,00
4,027 % éch. 15/07/2030				5,600 % éch. 25/10/2036	3 496	3 464	0,01	5,610 % éch. 25/05/2037	3 190	3 002	0,01
BNC Mortgage Loan Trust				5,615 % éch. 25/08/2036	2 101	1 884	0,00	5,630 % éch. 25/02/2037	9 514	9 154	0,01
3,821 % éch. 25/10/2036	\$ 5 656	4 089	0,01	5,645 % éch. 25/10/2036	400	383	0,00	5,630 % éch. 25/02/2037	14 686	13 781	0,02
5,310 % éch. 25/03/2037	10 205	9 517	0,02	5,780 % éch. 25/02/2035	1 955	1 785	0,00	5,630 % éch. 25/03/2047 ^	6 950	6 062	0,01
5,400 % éch. 25/07/2037	9 737	8 163	0,01	5,825 % éch. 25/10/2035 ^	2 193	2 120	0,00	5,633 % éch. 25/06/2036 ^	5 026	4 278	0,01
5,460 % éch. 25/05/2037	5 954	5 408	0,01	5,885 % éch. 25/09/2035	2 375	2 345	0,00	5,650 % éch. 25/04/2046 ^	5 164	4 942	0,01
5,470 % éch. 25/11/2036	1 184	1 129	0,00	5,930 % éch. 25/01/2036	792	785	0,00	5,670 % éch. 25/09/2046 ^	16 343	15 534	0,02
BNPP AM Euro CLO DAC	€ 11 680	12 452	0,02	6,830 % éch. 25/07/2035	3 840	3 026	0,01	5,670 % éch. 25/09/2046 ^	2 556	2 407	0,00
3,827 % éch. 15/10/2031				Commonbond Student Loan Trust				5,675 % éch. 25/08/2036	4 064	3 873	0,01
Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp. Trust				2,550 % éch. 25/05/2041	2 001	1 848	0,00	5,705 % éch. 25/07/2036	2 908	2 616	0,00
7,180 % éch. 15/12/2029	\$ 980	125	0,00	6,000 % éch. 25/05/2041	118	116	0,00	5,735 % éch. 25/04/2036	1 000	899	0,00
7,440 % éch. 15/12/2029	10 140	1 337	0,00	Conseco Finance Corp.				5,735 % éch. 25/06/2036 ^	3 260	3 083	0,01
7,575 % éch. 15/06/2030	936	120	0,00	6,560 % éch. 01/11/2028	979	970	0,00	5,750 % éch. 25/06/2036	1 229	1 217	0,00
Caim CLO DAC	€ 25 564	27 465	0,04	6,920 % éch. 01/12/2030	2 506	2 505	0,00	5,805 % éch. 25/04/2036 ^	16 089	15 515	0,02
3,912 % éch. 31/01/2030				7,060 % éch. 01/02/2031	1 430	1 269	0,00	5,850 % éch. 25/03/2036 ^	5 849	5 048	0,01
Camber PLC	\$ 30 714	182	0,00	7,500 % éch. 01/03/2030	12 877	5 030	0,01	5,855 % éch. 25/09/2035	1 497	1 408	0,00
1,571 % éch. 09/11/2053				7,850 % éch. 15/11/2026	21	21	0,00	5,870 % éch. 25/08/2035	1 794	1 583	0,00
Capitalsource Real Estate Loan Trust				7,860 % éch. 01/03/2030	4 756	1 931	0,00	5,971 % éch. 25/09/2046 ^	682	687	0,00
5,861 % éch. 20/01/2037	8 401	7 739	0,01	Conseco Finance Securitizations Corp.				5,989 % éch. 25/10/2046 ^	55	52	0,00
5,961 % éch. 20/01/2037	5 400	4 514	0,01	6,977 % éch. 01/09/2033	1 718	1 688	0,00	5,990 % éch. 25/10/2047	1 100	1 045	0,00
6,061 % éch. 20/01/2037	3 000	2 453	0,00	7,100 % éch. 01/02/2033	68	67	0,00	6,050 % éch. 25/02/2036 ^	4 162	3 881	0,01
Carbone CLO Ltd.				7,770 % éch. 01/09/2031	836	824	0,00	6,050 % éch. 25/05/2036	218	210	0,00
6,390 % éch. 20/01/2031	4 294	4 264	0,01	7,970 % éch. 01/05/2032	1 887	370	0,00	6,125 % éch. 25/12/2035	891	875	0,00
Carrington Mortgage Loan Trust				8,060 % éch. 01/09/2029	14 402	3 033	0,01	6,125 % éch. 25/01/2036	6 110	5 919	0,01
5,300 % éch. 25/04/2036 ^	2 105	2 010	0,00	8,260 % éch. 01/12/2030	13 372	3 495	0,01	6,140 % éch. 25/02/2036 ^	4 000	3 482	0,01
5,300 % éch. 25/08/2036	8 951	8 456	0,01	8,310 % éch. 01/05/2032	20 172	4 120	0,01	6,155 % éch. 25/10/2035	4 175	4 102	0,01
5,310 % éch. 25/10/2036	11 722	11 291	0,02	Countrywide Asset-Backed Certificates				6,215 % éch. 25/07/2035	2 979	2 942	0,01
5,410 % éch. 25/02/2037	14 783	13 377	0,02	5,430 % éch. 25/03/2037	2 180	2 074	0,00	6,215 % éch. 25/08/2035	1 627	1 621	0,00
5,750 % éch. 25/01/2036	1 064	1 015	0,00	5,630 % éch. 25/04/2037							

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
7,100 % éch. 25/08/2035	\$ 4 950	\$ 4 617	0,01	7,775 % éch. 25/12/2034	\$ 657	\$ 569	0,00	Galaxy CLO Ltd.			
7,250 % éch. 25/08/2035	604	452	0,00	8,525 % éch. 25/10/2034	1 104	1 003	0,00	6,338 % éch. 16/05/2031	\$ 4 425	\$ 4 372	0,01
7,500 % éch. 25/10/2034	534	502	0,00	FAB CBO BV				GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates			
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				4,192 % éch. 20/08/2080	€ 321	351	0,00	5,790 % éch. 25/12/2035	1 322	1 247	0,00
5,650 % éch. 25/10/2034	3 201	3 052	0,01	FBR Securitization Trust				5,810 % éch. 25/10/2035	1 334	1 284	0,00
5,690 % éch. 25/12/2034	5 112	4 941	0,01	5,885 % éch. 25/11/2035	\$ 11 731	10 625	0,02	5,810 % éch. 25/12/2035	1 696	1 319	0,00
5,870 % éch. 25/07/2034	571	563	0,00	Fidelity Grand Harbour CLO DAC				GE-WMC Mortgage Securities Trust			
6,005 % éch. 25/08/2034	555	552	0,00	4,726 % éch. 15/03/2032	€ 5 196	5 572	0,01	5,410 % éch. 25/08/2036	6 664	6 138	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				Fieldstone Mortgage Investment Trust				GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC			
5,171 % éch. 25/03/2035	5 537	5 356	0,01	5,378 % éch. 25/11/2036	\$ 3 292	1 916	0,00	3,930 % éch. 20/10/2030	€ 966	1 036	0,00
5,890 % éch. 25/08/2047	13 062	12 430	0,02	5,418 % éch. 25/11/2036	7 752	6 890	0,01	Goodgreen Trust			
5,900 % éch. 25/03/2034	2 775	2 703	0,00	5,530 % éch. 25/05/2036	6 983	4 801	0,01	3,930 % éch. 15/10/2053	\$ 11 219	9 994	0,02
6,650 % éch. 25/02/2035	5 912	5 780	0,01	5,618 % éch. 25/11/2036	2 631	1 531	0,00	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.			
Countrywide Asset-Backed Securities Notes Trust				5,795 % éch. 25/02/2036	10 407	9 224	0,02	6,373 % éch. 15/09/2037	22 512	22 211	0,04
7,150 % éch. 25/08/2047	112	109	0,00	7,175 % éch. 25/02/2035	1 063	1 008	0,00	GSAA Home Equity Trust			
Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust				Finance America Mortgage Loan Trust				5,250 % éch. 25/09/2036	4 071	977	0,00
5,373 % éch. 15/05/2036	725	710	0,00	6,095 % éch. 25/11/2034	629	552	0,00	5,250 % éch. 25/12/2046	2 438	1 225	0,00
5,393 % éch. 15/05/2036	693	657	0,00	6,170 % éch. 25/11/2034	459	382	0,00	5,270 % éch. 25/05/2036	6 561	1 645	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				First Franklin Mortgage Loan Trust				5,270 % éch. 25/11/2036	5 050	1 276	0,00
6,500 % éch. 25/05/2044	23	23	0,00	4,234 % éch. 25/03/2036	1 697	1 682	0,00	5,290 % éch. 25/12/2046	7 011	2 089	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization CBO Ltd.				5,250 % éch. 25/03/2037	5 063	2 450	0,00	5,310 % éch. 25/02/2037	6 044	1 876	0,00
5,588 % éch. 16/02/2041	54 641	853	0,00	5,260 % éch. 25/12/2037	557	523	0,00	5,330 % éch. 25/07/2036	1 323	295	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				5,270 % éch. 25/11/2036	7 226	6 667	0,01	5,350 % éch. 25/03/2037	8 029	2 456	0,00
2,817 % éch. 25/05/2036	3 598	2 366	0,00	5,270 % éch. 25/12/2036	7 825	7 262	0,01	5,470 % éch. 25/06/2036	4 375	970	0,00
3,044 % éch. 25/12/2036 ^	4 239	3 375	0,01	5,300 % éch. 25/03/2037	638	310	0,00	5,490 % éch. 25/09/2036	5 540	1 340	0,00
3,208 % éch. 25/12/2035	365	349	0,00	5,310 % éch. 25/10/2036	4 759	4 672	0,01	5,490 % éch. 25/03/2047	19 536	6 041	0,01
3,289 % éch. 25/03/2034	341	340	0,00	5,310 % éch. 25/11/2036	8 365	8 224	0,01	5,510 % éch. 25/03/2036	11 701	4 487	0,01
3,506 % éch. 25/04/2037	5 575	3 453	0,01	5,310 % éch. 25/12/2037	8 064	6 949	0,01	5,510 % éch. 25/12/2036	13 161	3 741	0,01
4,727 % éch. 25/12/2037	680	729	0,00	5,360 % éch. 25/12/2037	11 910	10 288	0,02	5,530 % éch. 25/03/2036	8 320	3 048	0,01
5,450 % éch. 25/10/2036	2 963	2 453	0,00	5,430 % éch. 25/12/2036	13 847	5 882	0,01	5,558 % éch. 25/05/2035	314	289	0,00
8,525 % éch. 25/01/2033 ^	286	246	0,00	5,450 % éch. 25/08/2036	1 118	1 018	0,00	5,630 % éch. 25/11/2036	7 394	2 612	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust				5,460 % éch. 25/07/2036	3 734	3 528	0,01	5,676 % éch. 25/09/2035	3 303	2 261	0,00
3,287 % éch. 25/03/2037 ^	110	42	0,00	5,460 % éch. 25/09/2036	5 624	5 187	0,01	5,750 % éch. 25/03/2036	3 340	1 825	0,00
3,535 % éch. 25/02/2037 ^	699	428	0,00	5,470 % éch. 25/04/2036	6 254	5 981	0,01	5,750 % éch. 25/05/2047	112	75	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				5,470 % éch. 25/06/2036	5 489	5 313	0,01	5,788 % éch. 25/05/2037 ^	5 899	2 631	0,00
3,075 % éch. 25/07/2036	2 139	1 993	0,00	5,630 % éch. 25/08/2036	7 295	6 694	0,01	5,870 % éch. 25/10/2035	2 104	1 836	0,00
3,156 % éch. 25/01/2037 ^	4 142	1 296	0,00	5,630 % éch. 25/10/2036	13 539	9 151	0,01	5,885 % éch. 25/06/2035	2 200	2 118	0,00
5,370 % éch. 25/11/2036	10 391	4 885	0,01	5,750 % éch. 25/02/2036	4 037	3 645	0,01	5,910 % éch. 25/01/2036	465	40	0,00
5,450 % éch. 25/11/2036	2 439	1 146	0,00	5,825 % éch. 25/11/2035	1 347	1 311	0,00	5,917 % éch. 25/03/2037 ^	2 327	483	0,00
5,610 % éch. 25/11/2036	846	397	0,00	5,840 % éch. 25/01/2036	3 122	2 820	0,01	6,000 % éch. 25/10/2037 ^	111	96	0,00
5,630 % éch. 25/10/2036	9 908	6 612	0,01	5,855 % éch. 25/05/2036	176	175	0,00	6,095 % éch. 25/08/2035	2 004	1 794	0,00
CSAB Mortgage-Backed Trust				5,870 % éch. 25/08/2034	880	826	0,00	6,300 % éch. 25/03/2037 ^	5 665	1 413	0,00
5,610 % éch. 25/11/2036	7 941	1 166	0,00	5,870 % éch. 25/10/2035	26	26	0,00	6,376 % éch. 25/09/2036	716	196	0,00
5,858 % éch. 25/05/2037	5 422	1 387	0,00	5,870 % éch. 25/11/2035	2 481	2 285	0,00	6,459 % éch. 25/09/2036 ^	4 796	1 313	0,00
5,898 % éch. 25/05/2037 ^	815	209	0,00	5,900 % éch. 25/12/2035	4 060	3 860	0,01	6,483 % éch. 25/03/2037 ^	5 301	1 610	0,00
6,580 % éch. 25/09/2036	2 145	724	0,00	5,975 % éch. 25/06/2034	350	349	0,00	6,500 % éch. 25/10/2037	1 133	597	0,00
CVC Cordatus Loan Fund DAC				6,050 % éch. 25/07/2035	1 150	1 125	0,00	6,599 % éch. 25/03/2037	2 097	521	0,00
3,855 % éch. 21/07/2030	€ 37 050	39 755	0,06	6,080 % éch. 25/07/2034	143	142	0,00	GSAMP Trust			
4,411 % éch. 23/10/2034	10 600	11 418	0,02	6,095 % éch. 25/03/2035	754	736	0,00	3,332 % éch. 25/11/2034	1 345	1 268	0,00
4,423 % éch. 20/08/2034	5 000	5 319	0,01	6,095 % éch. 25/09/2035	4 706	4 117	0,01	5,200 % éch. 25/12/2046	305	153	0,00
Dryden CLO Ltd.				6,425 % éch. 25/07/2034	1 461	1 421	0,00	5,250 % éch. 25/12/2046	1 369	689	0,00
6,232 % éch. 18/04/2031	\$ 6 600	6 537	0,01	6,575 % éch. 25/10/2034	406	404	0,00	5,270 % éch. 25/12/2036	4 932	2 420	0,00
6,380 % éch. 15/01/2031	3 731	3 702	0,01	6,950 % éch. 25/09/2034	1 708	1 716	0,00	5,280 % éch. 25/12/2046	5 250	2 858	0,01
Dryden Euro CLO BV				First NLC Trust				5,290 % éch. 25/11/2036	4 861	2 317	0,00
3,927 % éch. 15/07/2032	€ 935	1 004	0,00	5,220 % éch. 25/08/2037	6 157	3 156	0,01	5,290 % éch. 25/03/2047	6 201	5 533	0,01
Dryden Euro CLO DAC				5,290 % éch. 25/08/2037	185	95	0,00	5,300 % éch. 25/12/2046	462	233	0,00
3,987 % éch. 15/01/2032	3 265	3 509	0,01	5,330 % éch. 25/08/2037	3 340	1 712	0,00	5,310 % éch. 25/08/2036	2 211	1 752	0,00
4,057 % éch. 15/04/2034	3 000	3 176	0,01	5,430 % éch. 25/08/2037	46	24	0,00	5,310 % éch. 25/01/2037	15 493	9 071	0,01
Dryden Senior Loan Fund				5,885 % éch. 25/02/2036	4 467	3 669	0,01	5,320 % éch. 25/12/2036	7 221	3 542	0,01
6,230 % éch. 15/04/2031	\$ 22 350	22 173	0,04	Fremont Home Loan Trust				5,320 % éch. 25/01/2037	4 875	4 685	0,01
ECMC Group Student Loan Trust				5,280 % éch. 25/11/2036	5 288	1 920	0,00	5,350 % éch. 25/11/2036	1 187	575	0,00
6,200 % éch. 25/05/2067	15 461	15 020	0,02	5,285 % éch. 25/10/2036	11 907	10 487	0,02	5,380 % éch. 25/12/2046	681	343	0,00
EFV Volunteer LLC				5,290 % éch. 25/01/2037	21 477	10 919	0,02	5,390 % éch. 25/09/2036	17 913	6 522	0,01
6,105 % éch. 25/10/2035	629	628	0,00	5,300 % éch. 25/10/2036	12 540	5 120	0,01	5,420 % éch. 25/03/2047	5 838	5 391	0,01
Ellington Loan Acquisition Trust				5,350 % éch. 25/08/2036	6 764	2 269	0,00	5,430 % éch. 25/06/2036	1 998	1 933	0,00
6,200 % éch. 25/05/2037	9 878	9 289	0,02	5,370 % éch. 25/11/2036	6 678	2 424	0,00	5,450 % éch. 25/06/2036	6 161	3 380	0,01
6,250 % éch. 25/05/2037	13 011	12 565	0,02	5,430 % éch. 25/02/2037	13 354	10 290	0,02	5,450 % éch. 25/08/2036	1 411	1 379	0,00
6,650 % éch. 25/05/2037	1 529	1 487	0,00	5,470 % éch. 25/05/2036	8 754	5 176	0,01	5,450 % éch. 25/12/2036	1 246	1 180	0,00
Encore Credit Receivables Trust				5,490 % éch. 25/02/2036	4 076	3 857	0,01	5,470 % éch. 25/04/2036	4 840	3 021	0,01
5,885 % éch. 25/07/2035	1 899	1 722	0,00	5,690 % éch. 25/02/2036	300	255	0,00	5,520 % éch. 25/03/2047	3 302	2 477	0,00
6,050 % éch. 25/01/2036	828	780	0,00	5,765 % éch. 25/11/2035	5 829	5 016	0,01	5,525 % éch. 25/10/2046	6 000	4 898	0,01
6,080 % éch. 25/11/2035	4 103	3 711	0,01	5,810 % éch. 25/01/2036	1 390	1 291	0,00	5,630 % éch. 25/06/2036	2 088	1 113	0,00
6,125 % éch. 25/01/2036	4 142	3 616	0,01	5,825 % éch. 25/01/2036	6 546	4 821	0,01	5,630 % éch. 25/03/2046	235	227	0,00
6,170 % éch. 25/07/2035	2 138	1 870	0,00	5,830 % éch. 25/11/2035	296	289	0,00	5,670 %			

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
6,125 % éch. 25/03/2035 ^	\$ 1 053	\$ 938	0,00	5,780 % éch. 25/05/2035 ^	\$ 5 614	\$ 5 072	0,01	5,945 % éch. 25/06/2034	\$ 2 301	\$ 2 227	0,00
6,125 % éch. 25/04/2035 ^	2 010	1 832	0,00	5,855 % éch. 25/09/2035	155	153	0,00	6,200 % éch. 25/06/2035	5 082	4 919	0,01
6,200 % éch. 25/06/2034	455	420	0,00	5,900 % éch. 25/06/2035	4 606	4 465	0,01	6,275 % éch. 25/04/2035	2 500	2 347	0,00
8,525 % éch. 25/02/2047	1 500	1 415	0,00	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				6,300 % éch. 25/09/2034	1 384	1 353	0,00
Harvest CLO DAC				3,815 % éch. 25/07/2036	2 124	2 074	0,00	6,575 % éch. 25/02/2035	6 916	6 180	0,01
4,027 % éch. 15/01/2032	€ 23 100	24 662	0,04	3,967 % éch. 25/11/2036	4 292	3 695	0,01	Madison Park Funding Ltd.			
Hildene TruPS Financials Note Securitization Ltd.				4,193 % éch. 25/11/2036	5 889	5 817	0,01	0,000 % éch. 29/07/2030	12 337	12 296	0,02
6,571 % éch. 10/10/2038	\$ 22 725	20 623	0,03	4,459 % éch. 25/01/2037 ^	2 578	1 412	0,00	Man GLG Euro CLO DAC			
Home Equity Asset Trust				5,230 % éch. 25/12/2036	3 087	1 622	0,00	3,857 % éch. 15/10/2030	€ 7 694	8 242	0,01
3,883 % éch. 25/02/2036	3 525	3 388	0,01	5,300 % éch. 25/12/2036	5 641	2 982	0,01	3,917 % éch. 15/10/2030	12 650	13 522	0,02
5,450 % éch. 25/11/2036	1 451	1 404	0,00	5,330 % éch. 25/07/2036	511	228	0,00	3,987 % éch. 15/10/2032	7 492	7 962	0,01
5,630 % éch. 25/10/2036	4 431	2 721	0,00	5,340 % éch. 25/03/2047	1 692	1 673	0,00	4,047 % éch. 15/01/2030	10 991	11 844	0,02
5,750 % éch. 25/07/2036	3 250	2 950	0,01	5,360 % éch. 25/10/2036	4 004	3 941	0,01	MAPS Ltd.			
5,810 % éch. 25/04/2036	2 529	2 211	0,00	5,360 % éch. 25/12/2036	5 642	2 996	0,01	4,212 % éch. 15/05/2043	\$ 19 381	17 313	0,03
5,855 % éch. 25/01/2036	2 812	2 658	0,00	5,380 % éch. 25/05/2037	2 290	2 198	0,00	Marlay Park CLO DAC			
5,945 % éch. 25/11/2035	622	614	0,00	5,390 % éch. 25/05/2037	7 378	7 315	0,01	3,917 % éch. 15/10/2030	€ 3 021	3 246	0,01
5,990 % éch. 25/01/2035	782	757	0,00	5,410 % éch. 25/03/2037	2 852	2 769	0,01	MASTR Asset-Backed Securities Trust			
6,050 % éch. 25/12/2034	89	87	0,00	5,410 % éch. 25/06/2037	2 020	2 010	0,00	5,200 % éch. 25/10/2036	\$ 4 037	1 313	0,00
6,095 % éch. 25/11/2035	523	491	0,00	5,420 % éch. 25/08/2036	6 700	5 965	0,01	5,250 % éch. 25/11/2036	103	33	0,00
6,095 % éch. 25/12/2035	620	568	0,00	5,440 % éch. 25/07/2036	436	423	0,00	5,295 % éch. 25/01/2037	22 242	6 401	0,01
6,395 % éch. 25/05/2035	1 048	974	0,00	5,450 % éch. 25/01/2037	537	512	0,00	5,300 % éch. 25/10/2036	6 870	2 254	0,00
6,650 % éch. 25/03/2035	867	811	0,00	5,450 % éch. 25/03/2037	7 847	7 049	0,01	5,320 % éch. 25/10/2036	45	44	0,00
6,800 % éch. 25/12/2034	575	555	0,00	5,530 % éch. 25/07/2036	1 800	1 721	0,00	5,350 % éch. 25/08/2036	8 389	3 067	0,01
6,850 % éch. 25/11/2034	383	373	0,00	5,555 % éch. 25/05/2036	2 406	2 333	0,00	5,350 % éch. 25/10/2036	5 455	2 758	0,00
6,900 % éch. 25/11/2034	297	287	0,00	5,555 % éch. 25/07/2036	3 001	2 908	0,01	5,360 % éch. 25/05/2037	6 697	6 309	0,01
Home Equity Loan Trust				5,585 % éch. 25/05/2036	5 026	4 713	0,01	5,410 % éch. 25/10/2036	513	238	0,00
5,380 % éch. 25/04/2037	415	401	0,00	5,590 % éch. 25/07/2036	1 998	1 788	0,00	5,420 % éch. 25/08/2036	7 491	3 054	0,01
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				5,600 % éch. 25/07/2036	3 786	3 174	0,01	5,450 % éch. 25/04/2036	2 139	546	0,00
5,270 % éch. 25/04/2037	5 756	3 977	0,01	5,660 % éch. 25/04/2036	5 628	4 381	0,01	5,450 % éch. 25/06/2036	3 564	1 350	0,00
5,290 % éch. 25/11/2036	5 360	4 817	0,01	5,680 % éch. 25/01/2037	5 706	4 929	0,01	5,450 % éch. 25/08/2036	14 185	5 200	0,01
5,310 % éch. 25/11/2036	3 721	3 168	0,01	6,630 % éch. 25/07/2036 ^	9 952	2 927	0,01	5,470 % éch. 25/10/2036	7 141	3 610	0,01
5,320 % éch. 25/04/2037	10 193	7 043	0,01	Kodiak CDO Ltd.				5,590 % éch. 25/11/2036	9 446	5 624	0,01
5,340 % éch. 25/04/2037	9 601	6 265	0,01	5,324 % éch. 07/08/2037	3 242	3 088	0,01	5,630 % éch. 25/03/2036	3 052	1 876	0,00
5,340 % éch. 25/07/2037	7 953	3 245	0,01	LCM Loan Income Fund Income Note Issuer Ltd.				5,630 % éch. 25/08/2036	4 067	1 507	0,00
5,350 % éch. 25/07/2037	9 272	4 976	0,01	6,340 % éch. 16/07/2031	12 648	12 479	0,02	5,650 % éch. 25/10/2035 ^	4 757	4 444	0,01
5,360 % éch. 25/04/2037	1 239	856	0,00	LCM LP				5,650 % éch. 25/11/2035	2 634	1 524	0,00
5,390 % éch. 25/11/2036	602	449	0,00	6,270 % éch. 20/04/2031	50 000	49 467	0,08	5,720 % éch. 25/01/2036	2 386	2 327	0,00
5,390 % éch. 25/04/2037	10 445	6 817	0,01	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust				5,730 % éch. 25/01/2036	613	599	0,00
5,510 % éch. 25/06/2036	2 909	2 717	0,00	6,630 % éch. 15/04/2040	2 811	2 756	0,01	5,850 % éch. 25/09/2034	2 100	1 780	0,00
5,530 % éch. 25/06/2036	45	45	0,00	Lehman XS Trust				5,975 % éch. 25/10/2034	100	95	0,00
5,630 % éch. 25/08/2036	5 732	5 022	0,01	4,106 % éch. 25/06/2036	6	6	0,00	6,155 % éch. 25/03/2035	2 260	2 194	0,00
5,810 % éch. 25/03/2036	4 756	4 380	0,01	5,058 % éch. 25/01/2036 ^	2 078	1 930	0,00	6,300 % éch. 25/08/2037	6 658	5 529	0,01
6,215 % éch. 25/08/2035	1 800	1 672	0,00	5,350 % éch. 25/02/2037	10 121	9 004	0,01	6,875 % éch. 25/06/2035	100	99	0,00
6,395 % éch. 25/03/2035	2 936	2 841	0,01	5,460 % éch. 25/03/2037	2 385	2 096	0,00	7,685 % éch. 25/06/2035	1 659	1 639	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust				5,470 % éch. 25/05/2036	3 177	2 738	0,00	MASTR Specialized Loan Trust			
5,300 % éch. 25/12/2036	2 570	2 270	0,00	5,490 % éch. 25/10/2036	1 710	1 553	0,00	5,520 % éch. 25/01/2037	3 949	1 605	0,00
5,340 % éch. 25/01/2037	13 232	9 151	0,01	5,490 % éch. 25/12/2036	3 959	3 687	0,01	5,670 % éch. 25/06/2046	1 456	1 385	0,00
5,370 % éch. 25/12/2036	16 449	7 093	0,01	5,570 % éch. 25/06/2046	4 463	4 083	0,01	6,523 % éch. 25/07/2035	451	426	0,00
5,410 % éch. 25/04/2037	11 818	6 056	0,01	5,610 % éch. 25/02/2037	5 430	4 072	0,01	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,470 % éch. 25/10/2036	18 526	7 530	0,01	5,670 % éch. 25/05/2046 ^	1 566	1 393	0,00	5,430 % éch. 25/04/2037	658	298	0,00
5,525 % éch. 25/05/2037	4 026	3 860	0,01	5,670 % éch. 25/02/2047	2 034	1 825	0,00	5,510 % éch. 25/06/2037	674	520	0,00
5,590 % éch. 25/12/2036	17 797	4 806	0,01	5,730 % éch. 25/09/2036	3 532	3 071	0,01	6,150 % éch. 25/10/2037	7 010	5 800	0,01
5,675 % éch. 25/02/2036	3 065	2 614	0,00	6,260 % éch. 25/11/2035	2 737	1 270	0,00	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5,690 % éch. 25/12/2035	490	484	0,00	6,390 % éch. 25/04/2036 ^	28	37	0,00	5,370 % éch. 25/07/2037	6 166	2 729	0,00
5,735 % éch. 25/12/2035	3 500	3 229	0,01	6,790 % éch. 24/06/2046	222	279	0,00	5,390 % éch. 25/02/2037	3 990	1 201	0,00
5,765 % éch. 25/01/2036	8 126	7 409	0,01	7,450 % éch. 25/12/2037	982	995	0,00	5,430 % éch. 25/05/2037	5 219	2 766	0,00
Humboldt Americas LLC				Long Beach Mortgage Loan Trust				5,430 % éch. 25/11/2037	7 977	4 123	0,01
0,000 % éch. 31/07/2022	COP 20 000 000	4 722	0,01	5,310 % éch. 25/12/2036	23 063	15 816	0,03	5,450 % éch. 25/06/2037	3 619	932	0,00
ICG Euro CLO DAC				5,320 % éch. 25/12/2036	85	31	0,00	5,450 % éch. 25/08/2037	14 610	10 082	0,02
2,150 % éch. 15/10/2034	€ 6 000	5 360	0,01	5,330 % éch. 25/09/2036	13 442	3 774	0,01	5,450 % éch. 25/11/2037	3 560	1 251	0,00
IndyMac Manufactured Housing Contract Pass-Through Certificates				5,350 % éch. 25/07/2036	6 297	2 548	0,00	5,470 % éch. 25/03/2037	10 778	9 454	0,02
6,750 % éch. 25/02/2028	\$ 5	5	0,00	5,370 % éch. 25/11/2036	328	104	0,00	5,470 % éch. 25/07/2037	3 013	1 741	0,00
IXIS Real Estate Capital Trust				5,380 % éch. 25/12/2036	1 412	517	0,00	5,530 % éch. 25/04/2047	6 340	2 642	0,00
5,210 % éch. 25/05/2037	21 378	5 359	0,01	5,390 % éch. 25/08/2036	19 494	8 043	0,01	5,650 % éch. 25/07/2037	3 456	838	0,00
5,450 % éch. 25/01/2037	13 909	5 056	0,01	5,440 % éch. 25/07/2036	4 984	3 604	0,01	5,670 % éch. 25/03/2037	2 645	757	0,00
5,470 % éch. 25/08/2036	3 218	950	0,00	5,450 % éch. 25/05/2036	9 643	5 609	0,01	5,670 % éch. 25/07/2037	5 386	2 417	0,00
5,550 % éch. 25/03/2036 ^	1 409	729	0,00	5,450 % éch. 25/07/2036	2 449	994	0,00	5,750 % éch. 25/12/2036	2 621	2 454	0,00
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				5,450 % éch. 25/09/2036	801	510	0,00	5,750 % éch. 25/01/2037	5 374	4 847	0,01
2,810 % éch. 25/10/2035 ^	366	356	0,00	5,450 % éch. 25/11/2036	15 462	11 143	0,02	6,050 % éch. 25/02/2047	210	124	0,00
2,810 % éch. 25/10/2035	3 847	3 304	0,01	5,470 % éch. 25/05/2036	11 255	3 605	0,01	6,080 % éch. 25/07/2035	1 360	1 315	0,00
5,660 % éch. 25/02/2036 ^	2 412	2 339	0,00	5,470 % éch. 25/08/2036	2 476	1 025	0,00	6,230 % éch. 25/10/2035	146	143	0,00
5,690 % éch. 25/02/2036 ^	2 711	2 343	0,00	5,470 % éch. 25/09/2036	10 454	2 945	0,01	6,275 % éch. 25/08/2036	3 078	3 099	0,01
5,690 % éch. 25/03/2036	6 125	5 683	0,01	5,470 % éch. 2							

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
5,240 % éch. 25/01/2037	\$ 16 118	\$ 7 388	0,01	Mountain View CLO LLC				5,690 % éch. 25/01/2036	\$ 17 298	\$ 15 434	0,02
5,250 % éch. 25/07/2036	6 504	2 472	0,00	6,350 % éch. 16/10/2029	\$ 33 807	\$ 33 598	0,05	5,885 % éch. 25/05/2035	3 000	2 794	0,00
5,250 % éch. 25/10/2036	1 365	594	0,00	Nassau Ltd.				5,885 % éch. 25/08/2035	158	154	0,00
5,260 % éch. 25/10/2036	5 144	2 713	0,00	6,410 % éch. 15/10/2029	8 625	8 613	0,01	5,945 % éch. 25/05/2034	1 941	1 868	0,00
5,260 % éch. 25/12/2036	3 704	1 842	0,00	National Collegiate Student Loan Trust				6,020 % éch. 25/05/2035	700	570	0,00
5,260 % éch. 25/02/2037	3 273	1 045	0,00	5,460 % éch. 25/05/2032	6 362	6 043	0,01	Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates			
5,260 % éch. 25/03/2037	426	188	0,00	5,470 % éch. 27/10/2031	9 809	9 573	0,02	5,840 % éch. 25/11/2035	2 469	2 317	0,00
5,280 % éch. 25/02/2037	74	67	0,00	5,500 % éch. 25/03/2033	8 054	7 548	0,01	Owinit Mortgage Loan Trust			
5,290 % éch. 25/10/2036	14 055	6 114	0,01	5,520 % éch. 25/06/2033	2 749	2 584	0,00	3,157 % éch. 25/12/2035 ^	1 051	612	0,00
5,290 % éch. 25/05/2037	24 074	19 204	0,03	Nationstar Home Equity Loan Trust				5,370 % éch. 25/07/2037	1 164	971	0,00
5,300 % éch. 25/11/2036	7 057	3 887	0,01	5,325 % éch. 25/06/2037	3 019	2 935	0,01	OZLM Ltd.			
5,300 % éch. 25/12/2036	10 953	5 448	0,01	5,470 % éch. 25/04/2037	7 643	7 468	0,01	6,300 % éch. 20/04/2031	1 000	990	0,00
5,300 % éch. 25/02/2037	4 883	2 359	0,00	Navient Private Education Loan Trust				OZLME DAC			
5,330 % éch. 25/02/2037	632	202	0,00	2,650 % éch. 15/12/2028	135	135	0,00	4,162 % éch. 24/08/2030	€ 2 308	2 469	0,00
5,350 % éch. 25/05/2037	6 949	3 847	0,01	6,643 % éch. 16/07/2040	12 845	12 826	0,02	Palmer Square CLO Ltd.			
5,360 % éch. 25/01/2037	5 138	2 359	0,00	7,343 % éch. 15/12/2045	6 134	6 162	0,01	6,390 % éch. 17/01/2031	\$ 807	802	0,00
5,400 % éch. 25/07/2036	8 168	7 041	0,01	New Century Home Equity Loan Trust				Palmer Square European CLO DAC			
5,400 % éch. 25/12/2036	0	0	0,00	5,310 % éch. 25/08/2036	6 013	5 750	0,01	1,970 % éch. 15/04/2035	€ 6 000	5 348	0,01
5,400 % éch. 25/03/2037	2 196	970	0,00	5,510 % éch. 25/05/2036	1 162	1 133	0,00	Palmer Square European Loan Funding DAC			
5,410 % éch. 25/02/2037	844	408	0,00	5,795 % éch. 25/12/2035	7 106	6 708	0,01	4,727 % éch. 15/11/2032	35 600	38 436	0,06
5,450 % éch. 25/06/2036	3 709	1 942	0,00	5,825 % éch. 25/03/2035	2 153	2 124	0,00	Park Place Securities, Inc.			
5,450 % éch. 25/07/2036	3 443	1 320	0,00	5,870 % éch. 25/03/2035	4 567	4 394	0,01	5,885 % éch. 25/09/2035	\$ 6 045	5 902	0,01
5,470 % éch. 25/09/2036	3 820	1 709	0,00	5,885 % éch. 25/10/2035	6 885	5 620	0,01	6,095 % éch. 25/09/2035	2 506	2 261	0,00
5,480 % éch. 25/02/2037	12 765	6 169	0,01	5,915 % éch. 25/02/2035	3 660	3 344	0,01	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,630 % éch. 25/06/2036	23 262	16 090	0,03	6,080 % éch. 25/11/2034	2 945	2 817	0,01	5,885 % éch. 25/08/2035	6 752	6 479	0,01
5,630 % éch. 25/09/2036	24 633	9 298	0,02	6,095 % éch. 25/06/2035	479	475	0,00	5,885 % éch. 25/09/2035	6 612	6 361	0,01
5,645 % éch. 25/03/2036	6 831	5 759	0,01	6,095 % éch. 25/09/2035	7 903	7 638	0,01	5,945 % éch. 25/07/2035	3 191	3 151	0,01
5,650 % éch. 25/04/2036	8 935	8 253	0,01	6,125 % éch. 25/11/2034	277	271	0,00	6,095 % éch. 25/06/2035	624	618	0,00
5,650 % éch. 25/07/2036	1 634	631	0,00	6,125 % éch. 25/06/2035	4 903	4 696	0,01	6,125 % éch. 25/07/2035	5 600	4 575	0,01
5,720 % éch. 25/12/2035	6 235	5 005	0,01	6,155 % éch. 25/07/2035	12 000	11 629	0,02	6,155 % éch. 25/06/2035	2 903	2 748	0,00
5,720 % éch. 25/12/2035	120	115	0,00	6,215 % éch. 25/03/2035	342	307	0,00	6,185 % éch. 25/05/2035	3 000	2 363	0,00
5,750 % éch. 25/12/2035	3 500	3 222	0,01	Newcastle Mortgage Securities Trust				6,200 % éch. 25/09/2034	3 506	3 452	0,01
5,810 % éch. 25/01/2035	2 782	2 698	0,00	5,340 % éch. 25/04/2037	2 549	2 414	0,00	6,200 % éch. 25/06/2035	1 992	1 640	0,00
5,810 % éch. 25/11/2035	6 282	5 993	0,01	5,380 % éch. 25/04/2037	9 678	9 407	0,02	6,275 % éch. 25/03/2035	828	799	0,00
5,825 % éch. 25/12/2034	580	549	0,00	5,825 % éch. 25/03/2036	6 394	6 259	0,01	6,470 % éch. 25/01/2036 ^	5 451	4 961	0,01
5,825 % éch. 25/09/2035	4 865	4 515	0,01	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				6,725 % éch. 25/02/2035	8 091	7 825	0,01
5,855 % éch. 25/12/2034	413	372	0,00	5,430 % éch. 25/07/2036	10 729	8 755	0,01	6,920 % éch. 25/10/2034	5 729	5 409	0,01
5,890 % éch. 25/01/2034	1 664	1 617	0,00	5,630 % éch. 25/03/2036	2 393	2 230	0,00	6,950 % éch. 25/12/2034	8 743	8 602	0,01
5,975 % éch. 25/08/2034	548	500	0,00	5,645 % éch. 25/03/2036	5 146	4 757	0,01	7,025 % éch. 25/12/2034	6 871	6 140	0,01
6,050 % éch. 25/08/2034	1 082	1 031	0,00	5,810 % éch. 25/11/2035	3 981	3 767	0,01	7,250 % éch. 25/09/2034	107	92	0,00
6,065 % éch. 25/07/2034	389	388	0,00	5,810 % éch. 25/10/2036 ^	7 122	1 610	0,00	Penta CLO DAC			
6,065 % éch. 25/03/2035	326	322	0,00	5,915 % éch. 25/03/2035	1 664	1 621	0,00	4,211 % éch. 25/01/2033	€ 10 000	10 679	0,02
6,080 % éch. 25/11/2034	1 242	1 211	0,00	5,950 % éch. 25/02/2037 ^	9 883	2 944	0,01	People's Choice Home Loan Securities Trust			
6,080 % éch. 25/02/2035	2 224	1 980	0,00	6,492 % éch. 25/02/2037 ^	5 287	1 503	0,00	5,830 % éch. 25/12/2035 ^	\$ 6 467	6 162	0,01
6,095 % éch. 25/01/2035	3 746	3 293	0,01	6,532 % éch. 25/10/2036 ^	2 657	638	0,00	6,005 % éch. 25/08/2035	5 159	4 843	0,01
6,150 % éch. 25/07/2037	6 450	6 267	0,01	NovaStar Mortgage Funding Trust				6,095 % éch. 25/05/2035 ^	678	609	0,00
6,170 % éch. 25/08/2034	4	4	0,00	5,300 % éch. 25/03/2037	3 093	1 100	0,00	6,125 % éch. 25/05/2035	7 624	4 426	0,01
6,200 % éch. 25/04/2035	2 170	2 019	0,00	5,330 % éch. 25/03/2037	26 588	9 452	0,02	People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
6,200 % éch. 25/06/2035 ^	3 175	2 851	0,01	5,330 % éch. 25/09/2037	3 655	3 338	0,01	5,390 % éch. 25/09/2036	10 753	2 118	0,00
6,400 % éch. 25/07/2037	8 600	7 209	0,01	5,350 % éch. 25/09/2037	9 942	9 634	0,02	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
6,950 % éch. 25/05/2034	433	404	0,00	5,450 % éch. 25/06/2036	2 845	2 002	0,00	3,467 % éch. 25/11/2035	314	308	0,00
7,775 % éch. 25/03/2034	794	764	0,00	5,450 % éch. 25/09/2036	5 204	2 257	0,00	5,410 % éch. 25/11/2036	589	583	0,00
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				5,470 % éch. 25/05/2036	3 056	2 989	0,01	5,460 % éch. 25/06/2047 ^	888	821	0,00
5,690 % éch. 25/02/2036	3 568	3 139	0,01	5,490 % éch. 25/11/2036	1 281	401	0,00	5,645 % éch. 25/07/2036	2 258	2 113	0,00
5,690 % éch. 25/03/2036	9 534	7 721	0,01	5,490 % éch. 25/01/2037	19 066	6 681	0,01	5,735 % éch. 25/02/2036	1 441	1 415	0,00
5,705 % éch. 25/01/2036	2 869	2 215	0,00	5,690 % éch. 25/05/2036	400	374	0,00	5,917 % éch. 25/04/2035	1 431	1 354	0,00
5,730 % éch. 25/01/2036	1 498	1 434	0,00	5,840 % éch. 25/01/2036	5 700	5 241	0,01	Pretium Mortgage Credit Partners LLC			
5,730 % éch. 25/02/2036	209	205	0,00	5,855 % éch. 25/01/2036	943	932	0,00	2,240 % éch. 27/09/2060	10 766	10 177	0,02
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				5,870 % éch. 25/10/2035	2 653	2 603	0,00	Project Silver			
5,320 % éch. 25/04/2037	16 626	8 722	0,01	5,885 % éch. 25/01/2036	5 000	4 661	0,01	3,967 % éch. 15/07/2044	17 539	15 068	0,02
5,470 % éch. 25/04/2036	6 732	4 743	0,01	5,975 % éch. 25/06/2034	1 591	1 534	0,00	RAAC Trust			
5,660 % éch. 25/02/2036	5 534	4 992	0,01	6,875 % éch. 25/12/2034	770	674	0,00	5,420 % éch. 25/05/2036	144	140	0,00
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				7,025 % éch. 25/03/2035	2 983	2 929	0,01	5,650 % éch. 25/02/2037	2 492	2 385	0,00
5,200 % éch. 25/11/2036	1	0	0,00	Option One Mortgage Loan Trust				5,750 % éch. 25/06/2044	1 232	1 022	0,00
5,220 % éch. 25/11/2036	6 924	2 445	0,00	5,250 % éch. 25/07/2036	2 065	928	0,00	5,800 % éch. 25/06/2047	1 967	1 901	0,00
5,300 % éch. 25/11/2036	5 693	2 012	0,00	5,270 % éch. 25/03/2037	6 015	5 676	0,01	5,840 % éch. 25/11/2036	300	299	0,00
5,370 % éch. 25/11/2036	1 558	551	0,00	5,280 % éch. 25/07/2037	11 283	7 251	0,01	5,910 % éch. 25/10/2046	2 035	1 928	0,00
5,450 % éch. 25/07/2036	13 661	5 566	0,01	5,290 % éch. 25/01/2037	17 049	11 040	0,02	6,005 % éch. 25/03/2037	886	879	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				5,290 % éch. 25/02/2037	19 767	12 993	0,02	6,350 % éch. 25/10/2045	141	137	0,00
5,310 % éch. 25/11/2036	1 401	438	0,00	5,290 % éch. 25/03/2037	13 988	8 020	0,01	Raptor Aircraft Finance LLC			
5,390 % éch. 25/04/2037	14 896	4 383	0,01	5,320 % éch. 25/05/2037	20 038	10 985	0,02	4,213 % éch. 23/08/2044	47 428	37 353	0,06
5,490 % éch. 25/10/2036	8 126	2 502	0,00	5,330 % éch. 25/04/2037	669	336	0,00	Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,490 % éch. 25/11/2036	4 559	1 420	0,00	5,330 % éch. 25/07/2037	4 694	3 017	0,01	5,285 % éch. 25/01/2037	2 814	979	0,00
5,490 % éch. 25/01/2047 ^	3 768	1 233	0,00	5,340 % éch. 25/07/2037	1 789	1 516	0,00	5,294 % éch. 25/01/2037	18 457	6 432	0,01
5,630 % éch. 25/04/2037	3 572	1 052									

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
5,612 % éch. 25/04/2037	\$ 5 992	\$ 1 706	0,00	Saxon Asset Securities Trust				5,600 % éch. 25/05/2036	\$ 10 343	\$ 8 122	0,01
5,675 % éch. 25/06/2037 ^	421	122	0,00	1,501 % éch. 25/11/2035	\$ 2 994	\$ 2 867	0,01	5,615 % éch. 25/02/2036	3 890	3 536	0,01
5,731 % éch. 25/11/2036	4 836	1 822	0,00	1,942 % éch. 25/05/2035	3 960	3 471	0,01	5,615 % éch. 25/06/2036 ^	7 736	6 357	0,01
5,742 % éch. 25/04/2037	16 856	4 816	0,01	3,831 % éch. 25/08/2035	3 464	3 354	0,01	5,630 % éch. 25/07/2036	22 931	19 583	0,03
5,744 % éch. 25/06/2037 ^	5 934	1 740	0,00	5,330 % éch. 25/05/2037	2 532	1 786	0,00	5,650 % éch. 25/10/2036	12 593	11 759	0,02
5,746 % éch. 25/05/2036	2 134	1 059	0,00	5,350 % éch. 25/05/2047	8 831	7 654	0,01	5,650 % éch. 25/11/2036	2 978	2 765	0,00
5,761 % éch. 25/04/2037	2 781	797	0,00	5,460 % éch. 25/09/2037	9 438	8 911	0,01	5,668 % éch. 25/03/2036	6 864	5 594	0,01
5,762 % éch. 25/08/2036	8 258	3 290	0,01	5,550 % éch. 25/09/2047	3 640	3 331	0,01	5,675 % éch. 25/03/2036	504	499	0,00
5,797 % éch. 25/08/2036	12 841	5 228	0,01	5,600 % éch. 25/09/2036 ^	7 983	6 226	0,01	5,710 % éch. 25/10/2036	3 665	3 547	0,01
5,812 % éch. 25/11/2036	8 748	3 340	0,01	5,630 % éch. 25/10/2046	1 480	1 233	0,00	5,840 % éch. 25/12/2035	8 776	7 814	0,01
5,857 % éch. 25/05/2035	2 071	1 729	0,00	5,640 % éch. 25/09/2047	5 418	4 300	0,01	5,900 % éch. 25/01/2035	480	431	0,00
5,879 % éch. 25/06/2037 ^	2 974	893	0,00	5,810 % éch. 25/10/2035	3 657	3 454	0,01	5,990 % éch. 25/08/2035 ^	4 602	4 011	0,01
5,890 % éch. 25/08/2035	2 790	2 449	0,00	5,870 % éch. 25/11/2037	2 500	2 025	0,00	6,050 % éch. 25/10/2037	16 813	13 269	0,02
5,893 % éch. 25/06/2037 ^	28 633	8 624	0,01	6,125 % éch. 26/12/2034	629	528	0,00	6,080 % éch. 25/11/2035	57	57	0,00
5,906 % éch. 25/06/2037	7 657	2 311	0,00	6,900 % éch. 25/12/2037	7 596	6 397	0,01	6,100 % éch. 25/09/2037	1 733	1 356	0,00
5,910 % éch. 25/12/2032	41	37	0,00	SBA Tower Trust				6,125 % éch. 25/03/2036	3 410	2 974	0,01
6,011 % éch. 25/05/2036	3 091	1 601	0,00	3,869 % éch. 15/10/2049	5 000	4 848	0,01	6,150 % éch. 25/09/2037	4 192	2 849	0,01
6,120 % éch. 25/11/2036	11 903	4 777	0,01	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				6,185 % éch. 25/05/2035	652	640	0,00
6,166 % éch. 25/05/2036	3 374	1 791	0,00	5,270 % éch. 25/12/2036 ^	150	36	0,00	6,230 % éch. 25/07/2035	532	526	0,00
6,511 % éch. 25/07/2034	1 197	1 029	0,00	5,280 % éch. 25/05/2037 ^	8	6	0,00	6,250 % éch. 25/09/2037	1 565	1 225	0,00
6,998 % éch. 25/09/2037 ^	9 381	4 089	0,01	5,310 % éch. 25/08/2036	2 774	895	0,00	Southern Pacific Secured Asset Corp.			
7,238 % éch. 25/09/2037 ^	9 551	4 161	0,01	5,350 % éch. 25/05/2037 ^	4 892	2 945	0,01	5,550 % éch. 25/03/2028	64	59	0,00
Residential Asset Mortgage Products Trust				5,410 % éch. 25/12/2036	3 303	2 969	0,01	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
5,500 % éch. 25/10/2036	4 320	4 043	0,01	5,430 % éch. 25/05/2036	7 522	4 048	0,01	3,597 % éch. 25/09/2037	3 242	1 092	0,00
5,610 % éch. 25/12/2035	540	433	0,00	5,430 % éch. 25/06/2036	635	402	0,00	3,863 % éch. 25/09/2037	7 355	6 480	0,01
5,660 % éch. 25/03/2036	1 155	1 113	0,00	5,430 % éch. 25/09/2036	4 112	3 768	0,01	5,270 % éch. 25/04/2037	789	540	0,00
5,690 % éch. 25/02/2036	3 799	3 580	0,01	5,430 % éch. 25/01/2037	6 163	5 236	0,01	5,350 % éch. 25/04/2037	2 969	2 050	0,00
5,710 % éch. 25/07/2036	936	928	0,00	5,450 % éch. 25/03/2036	2 631	1 650	0,00	5,450 % éch. 25/06/2037	1 828	1 056	0,00
5,795 % éch. 25/02/2036	500	467	0,00	5,450 % éch. 25/09/2036	5 828	2 115	0,00	5,450 % éch. 25/11/2037	8 930	4 976	0,01
5,830 % éch. 25/12/2035	5 119	4 440	0,01	5,450 % éch. 25/12/2036	551	302	0,00	5,500 % éch. 25/03/2037	1 563	879	0,00
5,930 % éch. 25/07/2035	126	125	0,00	5,470 % éch. 25/09/2036	1 659	1 129	0,00	5,500 % éch. 25/04/2037	424	296	0,00
5,930 % éch. 25/09/2035	1 533	1 392	0,00	5,470 % éch. 25/10/2036	1 079	376	0,00	6,125 % éch. 25/12/2035	1 351	1 324	0,00
6,095 % éch. 25/10/2035	2 856	2 327	0,00	5,490 % éch. 25/08/2036 ^	12 271	3 957	0,01	St. Paul's CLO DAC			
6,125 % éch. 25/07/2035	1 906	1 781	0,00	5,590 % éch. 25/01/2037	1 035	729	0,00	4,097 % éch. 15/04/2033	€ 1 200	1 280	0,00
6,170 % éch. 25/05/2035	880	867	0,00	5,630 % éch. 25/07/2036	7 523	2 641	0,00	START Ltd.			
6,200 % éch. 25/08/2035	2 035	1 984	0,00	5,690 % éch. 25/03/2036	482	423	0,00	4,089 % éch. 15/03/2044	\$ 12 408	10 943	0,02
6,215 % éch. 25/05/2035	2 457	2 300	0,00	5,750 % éch. 25/11/2035	3 672	2 985	0,01	Starwood Commercial Mortgage Trust			
6,275 % éch. 25/06/2035	2 600	2 465	0,00	5,795 % éch. 25/10/2035	2 286	1 895	0,00	6,296 % éch. 15/07/2038	17 408	17 261	0,03
6,350 % éch. 25/01/2035 ^	2 470	2 257	0,00	5,825 % éch. 25/01/2035	547	510	0,00	6,616 % éch. 15/07/2038	14 830	14 089	0,02
Residential Asset Securities Corp. Trust				5,870 % éch. 25/10/2035	1 750	1 402	0,00	6,816 % éch. 15/07/2038	5 930	5 650	0,01
4,754 % éch. 25/04/2034	480	461	0,00	6,035 % éch. 25/10/2035	2 927	2 369	0,00	Structured Asset Investment Loan Trust			
4,906 % éch. 25/06/2034	1 846	1 787	0,00	6,110 % éch. 25/01/2036 ^	637	556	0,00	5,280 % éch. 25/07/2036	718	516	0,00
5,358 % éch. 25/01/2037	6 581	5 512	0,01	Segovia European CLO DAC				5,300 % éch. 25/07/2036	2 557	2 470	0,00
5,370 % éch. 25/01/2037	3 804	3 510	0,01	4,080 % éch. 20/07/2032	€ 4 600	4 890	0,01	5,323 % éch. 25/07/2036	15 556	9 276	0,02
5,370 % éch. 25/02/2037	6 826	6 511	0,01	SG Mortgage Securities Trust				5,470 % éch. 25/05/2036	221	213	0,00
5,410 % éch. 25/07/2036	27	27	0,00	5,470 % éch. 25/07/2036	\$ 23 205	4 988	0,01	5,470 % éch. 25/03/2036	1 628	1 576	0,00
5,430 % éch. 25/07/2036	3 837	3 612	0,01	5,510 % éch. 25/02/2036	3 621	2 076	0,00	5,700 % éch. 25/09/2034	3 970	3 700	0,01
5,430 % éch. 25/09/2036	3 589	3 490	0,01	5,690 % éch. 25/02/2036	1 905	1 102	0,00	5,750 % éch. 25/04/2036	8 832	4 753	0,01
5,490 % éch. 25/04/2037	6 836	6 354	0,01	5,855 % éch. 25/10/2035	921	842	0,00	5,770 % éch. 25/01/2036	3 791	3 491	0,01
5,570 % éch. 25/06/2036	400	39	0,00	6,035 % éch. 25/10/2035	1 083	864	0,00	5,780 % éch. 25/11/2035	6 873	6 582	0,01
5,585 % éch. 25/06/2036	3 422	3 263	0,01	SLM Private Credit Student Loan Trust				5,855 % éch. 25/03/2034	166	160	0,00
5,660 % éch. 25/04/2036	5 275	4 609	0,01	5,882 % éch. 15/06/2039	13 999	13 454	0,02	5,870 % éch. 25/04/2035	566	554	0,00
5,690 % éch. 25/07/2036	2 403	2 066	0,00	SLM Student Loan Trust				5,870 % éch. 25/07/2035	2 703	2 639	0,00
5,710 % éch. 25/04/2036	1 251	1 220	0,00	3,861 % éch. 25/10/2039	€ 2 260	2 300	0,00	5,870 % éch. 25/09/2035	283	265	0,00
5,735 % éch. 25/03/2036	2 561	2 523	0,00	3,811 % éch. 25/07/2039	12 693	13 085	0,02	5,870 % éch. 25/10/2035	1 520	1 488	0,00
5,750 % éch. 25/02/2036	1 410	1 382	0,00	3,811 % éch. 25/01/2040	24 600	24 561	0,04	5,870 % éch. 25/01/2036	118	114	0,00
5,765 % éch. 25/11/2035	98	93	0,00	4,076 % éch. 15/12/2033	9 706	9 772	0,02	5,900 % éch. 25/07/2035	4 125	3 938	0,01
5,780 % éch. 25/02/2036	2 810	2 625	0,00	6,955 % éch. 25/07/2023	\$ 7 253	7 249	0,01	5,915 % éch. 25/08/2035	1 568	1 504	0,00
5,795 % éch. 25/03/2035	153	152	0,00	SMB Private Education Loan Trust				5,915 % éch. 25/08/2035	1 939	1 838	0,00
5,810 % éch. 25/11/2035	761	756	0,00	5,993 % éch. 15/02/2036	1 333	1 320	0,00	6,050 % éch. 25/05/2035	4 128	4 016	0,01
5,810 % éch. 25/12/2035	3 988	3 784	0,01	SoFi Alternative Trust				6,080 % éch. 25/01/2035	4 584	4 431	0,01
5,830 % éch. 25/05/2037	1 182	1 153	0,00	3,491 % éch. 15/06/2050	16 081	15 343	0,02	6,080 % éch. 25/06/2035	5 691	5 354	0,01
5,840 % éch. 25/11/2035	997	979	0,00	3,688 % éch. 16/05/2050	16 811	16 167	0,03	6,150 % éch. 25/09/2034	3 363	3 286	0,01
5,855 % éch. 25/09/2035	895	837	0,00	Soloso CDO Ltd.				6,275 % éch. 25/07/2033	370	364	0,00
5,855 % éch. 25/10/2035	2 047	1 687	0,00	5,471 % éch. 07/10/2037	3 722	3 462	0,01	6,350 % éch. 25/12/2034	388	383	0,00
5,855 % éch. 25/11/2035	476	455	0,00	Soundview Home Loan Trust				6,378 % éch. 25/09/2034	354	340	0,00
5,870 % éch. 25/01/2036	4 882	4 707	0,01	5,230 % éch. 25/06/2037	3 262	2 197	0,00	6,425 % éch. 25/12/2034	1 302	1 249	0,00
6,020 % éch. 25/11/2035	3 825	3 091	0,01	5,270 % éch. 25/11/2036	8 708	2 529	0,00	6,530 % éch. 25/04/2033	13	12	0,00
6,110 % éch. 25/08/2035	3 088	3 029	0,01	5,300 % éch. 25/03/2037	5 321	4 952	0,01	6,650 % éch. 25/11/2034	699	697	0,00
6,185 % éch. 25/10/2035	2 013	1 893	0,00	5,300 % éch. 25/06/2037	17 304	11 652	0,02	Structured Asset Securities Corp.			
6,395 % éch. 25/03/2035	1 010	956	0,00	5,310 % éch. 25/01/2037	8 937	6 467	0,01	4,273 % éch. 25/02/2035	1 691	1 660	0,00
6,950 % éch. 25/04/2035	653	623	0,00	5,320 % éch. 25/07/2037	781	642	0,00	6,290 % éch. 25/02/2035	584	560	0,00
Residential Funding Mortgage Securities Home Equity Loan Trust				5,320 % éch. 25/08/2037							

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
5,380 % éch. 25/02/2037	\$ 12 258	\$ 11 699	0,02	5,750 % éch. 25/04/2037	\$ 1 000	\$ 689	0,00	Obligation internationale du gouvernement roumain			
5,380 % éch. 25/05/2047	6 733	6 387	0,01	6,150 % éch. 25/10/2034	745	731	0,00	1,750 % éch. 13/07/2030	€ 2 600	\$ 2 169	0,00
5,390 % éch. 25/01/2037	2 000	1 862	0,00	6,875 % éch. 25/11/2035	3 475	3 422	0,01	2,000 % éch. 14/04/2033	16 400	12 672	0,02
5,440 % éch. 25/07/2036 ^	6 958	6 619	0,01	7,250 % éch. 25/11/2035	2 472	2 365	0,00	2,125 % éch. 07/03/2028	3 100	2 942	0,00
5,460 % éch. 25/08/2046	4 471	4 150	0,01	7,550 % éch. 25/12/2034	817	800	0,00	2,750 % éch. 14/04/2041	30 800	20 676	0,03
5,490 % éch. 25/12/2036	603	591	0,00	7,700 % éch. 25/04/2035	751	752	0,00	3,750 % éch. 07/02/2034	14 300	12 642	0,02
5,570 % éch. 25/02/2037	185	179	0,00	8,900 % éch. 25/04/2035	1 592	1 652	0,00	Obligation internationale du gouvernement russe			
5,580 % éch. 25/03/2037	3 949	2 941	0,01	Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates				1,850 % éch. 20/11/2032 ^	2 800	1 436	0,00
5,650 % éch. 25/11/2037	21 706	16 526	0,03	5,890 % éch. 25/04/2034	207	199	0,00	4,250 % éch. 23/06/2027 ^	\$ 116 200	50 699	0,08
5,675 % éch. 25/07/2036	1 547	1 430	0,00					4,375 % éch. 21/03/2029 ^	6 000	2 670	0,00
5,770 % éch. 25/12/2036	13 350	7 681	0,01					4,750 % éch. 27/05/2026 ^	115 600	58 378	0,09
5,770 % éch. 25/02/2037	5 002	4 724	0,01					5,100 % éch. 28/03/2035 ^	20 000	8 900	0,01
5,825 % éch. 25/04/2035	113	101	0,00					5,250 % éch. 23/06/2047 ^	33 600	14 952	0,02
5,825 % éch. 25/06/2035	114	106	0,00					5,250 % éch. 23/06/2047 ^	311 800	18 708	0,03
6,050 % éch. 25/08/2037	2 465	2 421	0,00					5,625 % éch. 04/04/2042 ^	98 400	67 095	0,10
6,080 % éch. 25/05/2035	409	410	0,00					5,875 % éch. 16/09/2043 ^	26 600	16 776	0,03
6,155 % éch. 25/11/2035	1 000	983	0,00					7,150 % éch. 12/11/2025 ^ RUB	20 520 713	120 029	0,19
7,175 % éch. 25/07/2035	1 430	1 432	0,00					7,500 % éch. 31/03/2030 ^ \$	16 872	11 131	0,02
7,250 % éch. 25/11/2035	129	123	0,00					7,950 % éch. 07/10/2026 ^ RUB	7 973 492	46 638	0,07
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates								12,750 % éch. 24/06/2028 ^	\$ 41 736	41 371	0,06
5,975 % éch. 25/01/2035	517	505	0,00					Obligation internationale du gouvernement sud-africain			
Structured Asset Securities Corp. Trust								10,500 % éch. 21/12/2026 ZAR	11 472 400	630 697	0,98
5,420 % éch. 25/05/2031	344	244	0,00					State Agency of Roads of Ukraine			
6,888 % éch. 25/05/2031	1 283	1 023	0,00					6,250 % éch. 24/06/2030 ^ \$	1 500	329	0,00
Symphony CLO Ltd.								Obligation internationale du gouvernement turc			
6,140 % éch. 15/04/2028	3 822	3 808	0,01					4,250 % éch. 13/03/2025	201 100	188 079	0,29
Taberna Preferred Funding Ltd.								5,250 % éch. 13/03/2030 (n)	155 000	127 560	0,20
5,666 % éch. 05/05/2038	7 958	7 481	0,01					6,125 % éch. 24/10/2028	28 900	25 892	0,04
5,686 % éch. 05/12/2036	23 607	20 361	0,03					7,625 % éch. 26/04/2029	94 000	88 957	0,14
5,693 % éch. 05/07/2035	8 668	7 714	0,01					Obligation internationale du gouvernement ukrainien			
5,756 % éch. 05/11/2035	15 300	13 961	0,02					4,375 % éch. 27/01/2032 ^	€ 18 760	4 473	0,01
Terwin Mortgage Trust								Obligation internationale du gouvernement vénézuélien			
3,971 % éch. 25/08/2036	1 084	189	0,00					6,000 % éch. 09/12/2020 ^	\$ 9 289	581	0,00
5,490 % éch. 25/07/2037	5 092	4 834	0,01					7,000 % éch. 31/03/2038 ^	14 228	1 245	0,00
5,950 % éch. 25/09/2036	3 194	1 377	0,00					7,650 % éch. 21/04/2025 ^	28 167	2 465	0,00
TICP CLO Ltd.								7,750 % éch. 13/10/2019 ^	5 850	351	0,00
6,390 % éch. 20/01/2031	13 483	13 396	0,02					8,250 % éch. 13/10/2024 ^	35 331	3 268	0,01
Toro European CLO DAC								9,000 % éch. 07/05/2023 ^	13 516	1 216	0,00
3,917 % éch. 15/10/2030	€ 1 379	1 476	0,00					9,250 % éch. 15/09/2027 ^	34 519	3 107	0,00
4,097 % éch. 15/07/2030	2 451	2 655	0,00					9,250 % éch. 07/05/2028 ^	39 817	3 583	0,01
Trapeza CDO Ltd.								11,750 % éch. 21/10/2026 ^	3 990	369	0,00
5,509 % éch. 06/04/2042	\$ 6 135	5 399	0,01					12,750 % éch. 23/08/2022 ^	6 170	555	0,00
5,551 % éch. 10/10/2041	3 775	3 247	0,01								
5,559 % éch. 06/07/2041	8 759	7 368	0,01								
5,604 % éch. 09/11/2042	635	573	0,00								
5,619 % éch. 06/07/2041	9 000	6 570	0,01								
Tropic CDO Ltd.											
5,580 % éch. 15/07/2036	12 747	11 727	0,02								
6,010 % éch. 15/04/2034	117	116	0,00								
Truman Capital Mortgage Loan Trust											
5,630 % éch. 25/03/2036	1 294	1 136	0,00								
TruPS Financials Note Securitization Ltd.											
6,708 % éch. 30/03/2039	28 348	27 072	0,04								
7,080 % éch. 20/09/2039	7 127	6 663	0,01								
Venture CLO Ltd.											
6,140 % éch. 15/04/2027	19 161	19 099	0,03								
Vesey Park CLO DAC											
4,298 % éch. 16/11/2032	€ 4 500	4 804	0,01								
Voya Euro CLO DAC											
3,927 % éch. 15/10/2030	9 583	10 324	0,02								
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust											
5,280 % éch. 25/07/2047	\$ 5 797	3 349	0,01								
5,300 % éch. 25/01/2037	18 591	15 239	0,02								
5,320 % éch. 25/05/2037	3 389	2 790	0,00								
5,320 % éch. 25/07/2047	578	400	0,00								
5,340 % éch. 25/04/2037	24 897	9 435	0,02								
5,375 % éch. 25/05/2037	809	741	0,00								
5,400 % éch. 25/05/2037	3 247	2 689	0,00								
5,400 % éch. 25/07/2047	5 563	3 220	0,01								
5,510 % éch. 25/04/2037	788	300	0,00								
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust											
5,450 % éch. 25/05/2036	826	624	0,00								
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust											
5,470 % éch. 25/07/2036	3 200	3 038	0,01								
5,495 % éch. 25/01/2037	3 813	3 653	0,01								
5,570 % éch. 25/03/2037	1 563	1 525	0,00								
5,610 % éch. 25/04/2037	2 280	2 212	0,00								
5,660 % éch. 25/05/2036	3 877	3 757	0,01								

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
BPS	4,660 %	30/06/2023	05/07/2023	CAD 500 000	Obligation internationale du gouvernement canadien 2,500 % échéance 01/12/2032	\$ (225 563)	\$ 377 858	\$ 378 177	0,59
					Province du Québec				
					1,900 % - 2,750 % échéance 01/09/2027 - 01/09/2030	(161 448)			
	5,080	30/06/2023	07/07/2023	\$ 500 000	Billets du Trésor américain				
					0,250 % - 1,875 % échéance 31/07/2025 - 31/07/2026	(510 165)	500 000	500 494	0,78
BRC	5,120	30/06/2023	03/07/2023	417 900	Billets du Trésor américain				
					3,875 % échéance 30/04/2025	(426 648)	417 900	418 078	0,65
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	122 098	Billets du Trésor américain				
					4,625 % échéance 30/06/2025	(124 540)	122 098	122 122	0,19
MBC	5,130	28/06/2023	05/07/2023	200 000	Bons du Trésor américain				
					0,000 % échéance 01/08/2023	(144 409)	200 000	200 200	0,31
					Obligations du Trésor américain				
					4,000 % échéance 15/11/2042	(49 959)			
					Billets du Trésor américain				
					2,625 % échéance 31/12/2023	(10 645)			
	5,150	30/06/2023	07/07/2023	150 000	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/07/2024 - 15/07/2030	(60 417)	150 000	150 150	0,23
					Billets du Trésor américain				
					0,250 % - 2,250 % échéance 15/11/2024 - 30/09/2025	(94 406)			
	5,160	30/06/2023	03/07/2023	208 100	Billets du Trésor américain				
					3,875 % - 4,125 % échéance 30/11/2027 - 15/11/2032	(214 861)	208 100	208 189	0,32
NXN	5,140	30/06/2023	03/07/2023	105 100	Obligations du Trésor américain				
					2,875 % échéance 15/05/2049	(108 590)	105 100	105 145	0,16
SOG	5,130	31/05/2023	À définir ⁽²⁾	9 545	American International Group, Inc. 4,800 %, échéance 10/07/2045	(3 115)	9 545	9 545	0,01
					Amgen, Inc.				
					3,625 % échéance 22/05/2024	(1 966)			
					Barclays PLC				
					4,337 % échéance 10/01/2028	(3 300)			
					Morgan Stanley				
					1,593 % échéance 04/05/2027	(1 791)			
Total des Contrats de mise en pension						\$ (2 141 823)	\$ 2 090 601	\$ 2 092 100	3,24

⁽¹⁾ Comprend les intérêts courus.

⁽²⁾ Contrats de mise en pension à échéance ouverte.

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	2 299	\$ 15 355	0,02
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2025	1 188	5 242	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2026	1 289	4 198	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	1 498	8 763	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2025	1 206	4 402	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2024	1 990	12 742	0,02
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2025	1 087	4 306	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2026	1 206	3 704	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2024	1 390	7 087	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2025	986	3 368	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Court	09/2023	230	89	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	3 629	4 846	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	793	(2 238)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	3 439	(7 380)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	17 853	(15 340)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	881	(1 080)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à long terme septembre	Court	09/2023	6 124	(589)	0,00
				(11 324)	(0,02)
				\$ 36 151	0,06

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	1 147	\$ (500)	\$ (431)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	1 147	(402)	(57)	0,00
Option de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	123,000	21/07/2023	335	(129)	(51)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	131,000	21/07/2023	335	(172)	(66)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,000	15/09/2023	1 518	(2 502)	(110)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,063 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,063	15/12/2023	1 602	(3 282)	(336)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,125 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,125	15/12/2023	1 518	(2 806)	(309)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,188 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,188	15/09/2023	2 276	(4 434)	(134)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,375 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,375	15/12/2023	2 276	(4 742)	(374)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	98,000	15/12/2023	1 218	(359)	(63)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,000	15/09/2023	1 518	(2 882)	(5 356)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,063 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,063	15/12/2023	1 602	(3 122)	(5 896)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,125 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,125	15/12/2023	1 518	(2 920)	(5 815)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,188 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,188	15/09/2023	2 276	(4 499)	(9 053)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,375 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,375	15/12/2023	2 276	(4 833)	(10 038)	(0,02)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	1 218	(479)	(5 737)	(0,01)
				\$ (38 063)	\$ (43 826)	(0,07)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					\$ (7 675)	(0,01)

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
Airbus Finance BV	1,000 %	20/06/2028	€ 13 400	\$ (94)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2023	\$ 11 100	(109)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	69 900	313	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2025	9 500	(58)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	9 400	(84)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	4 300	31	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20/12/2023	€ 25 600	(1)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2023	\$ 20 400	95	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2024	5 570	174	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2025	11 800	263	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2025	11 700	292	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2024	12 100	(496)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/06/2026	3 300	(78)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2026	4 400	(148)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/06/2027	3 300	(14)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2024	18 900	(8)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/12/2024	44 900	(258)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2025	24 800	(225)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/12/2025	25 300	953	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2026	8 200	(159)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/12/2026	6 600	(123)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	11 500	(102)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	109 900	6 087	0,01
General Electric Co.	1,000	20/12/2024	7 600	198	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	53 500	148	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	6 700	(7)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2025	€ 10 000	641	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2025	25 100	2 210	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2026	41 400	2 428	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2026	114 700	2 386	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2027	18 100	923	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2026	\$ 6 700	(102)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2026	32 300	(539)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2028	34 900	122	0,00
				\$ 14 659	0,03

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

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 à 5 ans	(1,000) %	20/12/2025	\$ 107 200	\$ 1 063	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-30 à 5 ans	1,000 %	20/12/2023	\$ 378 250	\$ 6 617	0,01
Indice CDX.EM-31 à 5 ans	1,000	20/06/2024	99 588	4 024	0,01
Indice CDX.EM-32 à 5 ans	1,000	20/12/2024	71 910	3 328	0,01
Indice CDX.EM-34 à 5 ans	1,000	20/12/2025	218 224	4 447	0,01
Indice CDX.EM-35 à 5 ans	1,000	20/06/2026	1 380	20	0,00
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000	20/12/2026	705 640	37 066	0,05
Indice CDX.EM-37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	6 958	322	0,00
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	98 900	4 258	0,01
Indice CDX.EM-39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	194 100	5 117	0,01
Indice CDX.HY-34 à 5 ans	5,000	20/06/2025	5 040	(255)	0,00
Indice CDX.HY-35 à 5 ans	5,000	20/12/2025	8 330	(350)	0,00
Indice CDX.HY-36 à 5 ans	5,000	20/06/2026	417 578	6 815	0,01
Indice CDX.HY-37 à 5 ans	5,000	20/12/2026	149 646	(651)	0,00
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	5,000	20/06/2027	27 146	1 263	0,00
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	675 675	12 116	0,01
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	5,000	20/06/2028	4 399 800	122 269	0,19
Indice CDX.IG-37 à 5 ans	1,000	20/12/2026	1 400	(10)	0,00
Indice CDX.IG-38 à 5 ans	1,000	20/06/2027	400	3	0,00
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	12 700	37	0,00
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	99 700	719	0,00
				\$ 207 155	0,32

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	\$ 23 157	0,04
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,060	21/02/2052	14 400	(8 598)	(0,01)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,096	14/02/2052	31 300	(18 473)	(0,03)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,101	21/02/2052	14 400	(8 469)	(0,01)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,175	28/02/2052	28 800	(16 436)	(0,03)
À recevoir ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	903 200	65 793	0,10
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	20/09/2026	¥ 48 830 000	(4 125)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/03/2029	344 670 000	(6 871)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,020	20/09/2028	395 820 000	32 006	0,05
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,176	27/04/2027	22 270 000	146	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	52 440 000	(349)	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2042	27 980 000	(393)	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,711	27/04/2042	5 840 000	43	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/07/2023	\$ 212 800	2 894	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	18/07/2023	157 300	2 127	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	26/07/2023	154 700	2 098	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/08/2023	7 957 500	109 789	0,17
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	09/08/2023	22 000	(304)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	06/09/2023	344 400	4 796	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	15/09/2023	324 000	(4 522)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	16/09/2023	1 456 600	(20 781)	(0,03)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	16/09/2023	33 800	482	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	30/09/2023	1 155 100	(16 017)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2026	1 090 500	(79 704)	(0,12)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2028	2 503 737	(241 629)	(0,37)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,550	15/01/2031	4 567 800	982 369	1,52
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,674	05/08/2030	62 900	12 876	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,678	29/07/2030	65 200	13 342	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,711	28/07/2030	69 000	14 019	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,715	27/07/2030	200 000	40 617	0,06
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	30/03/2031	963 600	196 348	0,30
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	16/06/2031	3 358 883	(367 694)	(0,57)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,800	15/01/2051	1 479 300	713 175	1,10
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,928	06/05/2026	150 100	14 456	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,975	17/06/2052	52 200	17 761	0,03
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,990	24/06/2052	75 000	25 185	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	26/01/2024	154 700	(4 747)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	386 590	30 986	0,05
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	495 770	49 020	0,08
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	16/12/2030	120 615	21 044	0,03
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,035	28/06/2052	25 900	8 466	0,01
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,144	04/11/2050	49 600	(19 562)	(0,03)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,150	30/03/2051	191 500	2 818	0,00
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,215	13/10/2050	83 500	(32 963)	(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⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,235 %	12/05/2028	\$ 75 400	\$ 9 529	0,01
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2026	1 654 500	(176 098)	(0,27)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	15 560	2 146	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	635 270	(58 442)	(0,09)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/06/2051	1 456 600	314 245	0,49
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,270	04/11/2023	7 957 500	(130 424)	(0,20)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,280	24/03/2028	423 400	(48 033)	(0,07)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,306	02/11/2051	48 000	15 261	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,317	16/12/2050	33 800	(12 597)	(0,02)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,350	20/01/2027	109 100	10 887	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,360	15/02/2027	387 430	37 853	0,06
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,360	20/07/2031	91 400	15 994	0,02
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,370	19/07/2031	61 300	10 688	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,380	04/01/2027	212 800	(22 159)	(0,03)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,405	07/09/2031	154 300	26 370	0,04
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,418	20/01/2027	71 900	(6 903)	(0,01)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,420	24/02/2027	269 100	25 624	0,04
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,425	18/01/2027	146 000	(13 861)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,443	18/01/2027	157 300	(15 843)	(0,02)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,450	17/02/2027	361 600	34 255	0,05
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,450	16/07/2031	137 000	23 438	0,04
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,485	13/01/2051	78 100	(27 380)	(0,04)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/12/2028	473 684	(65 682)	(0,10)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	12/01/2029	85 443	10 684	0,02
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	05/10/2031	89 100	(14 695)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,518	20/01/2029	43 100	(5 328)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,535	15/10/2031	88 600	(14 370)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,535	22/10/2031	59 100	(9 528)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,545	26/10/2031	58 900	(9 457)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,550	20/01/2027	485 100	(43 633)	(0,07)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,570	11/01/2027	121 400	(11 060)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,570	12/01/2027	76 200	(6 944)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,573	28/02/2027	96 300	(9 321)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,580	16/02/2027	150 400	(13 220)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,595	13/01/2051	82 600	(27 264)	(0,04)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,600	16/01/2026	943 900	34 589	0,05
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,600	15/02/2027	1 549 700	(134 234)	(0,21)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,618	09/02/2029	27 100	(3 271)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,620	18/04/2027	153 700	(14 029)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630	20/01/2029	60 000	(7 090)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630	26/01/2029	72 000	(8 448)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,650	24/02/2027	897 000	(75 618)	(0,12)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,650	08/02/2032	91 900	(13 952)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,655	24/01/2032	72 000	(11 214)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	06/03/2024	344 400	(8 167)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	17/02/2027	1 446 200	(120 063)	(0,19)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	12/01/2029	310 700	(35 290)	(0,05)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,730	24/02/2032	86 300	(12 502)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,735	12/01/2032	57 800	(8 723)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	190 144	9 856	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	209 290	10 754	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	96 400	(7 381)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,765	16/03/2032	30 400	(4 262)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,770	14/02/2032	81 500	(11 616)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,783	22/04/2027	114 300	(9 672)	(0,02)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,785	12/08/2051	76 100	24 140	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,788	03/05/2027	114 800	(9 643)	(0,02)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,815	24/01/2052	14 400	(4 220)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,817	05/04/2032	318 600	(42 961)	(0,07)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,867	26/01/2052	14 400	(4 071)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,872	06/04/2032	160 000	(20 862)	(0,03)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,928	25/03/2027	159 500	(13 114)	(0,02)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,945	23/06/2051	127 800	35 483	0,05
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,988	09/02/2032	22 000	2 908	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2027	193 480	4 494	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2029	910 590	20 739	0,03
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	18/02/2032	133 700	(16 784)	(0,03)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	1 477 810	34 423	0,05
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	15/12/2051	324 000	7 909	0,01
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,008	09/02/2032	36 700	4 703	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,185	21/04/2029	96 000	(8 304)	(0,01)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,300	17/01/2026	678 900	24 629	0,04
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,350	17/01/2025	1 204 900	28 135	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,370	21/06/2027	159 400	(9 426)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,385	08/06/2032	26 800	2 201	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,430	30/09/2027	230 020	17 758	0,03
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	2 408 100	57 132	0,09
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,450	04/10/2027	221 690	16 907	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,451	08/06/2032	90 600	7 087	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,605	28/06/2027	158 600	(7 813)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,680	11/07/2032	27 300	(1 847)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,690	11/07/2032	27 300	(1 818)	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	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,850 %	30/08/2027	\$ 137 400	\$ (7 192)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,880	30/09/2027	657 200	(32 153)	(0,05)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,900	04/10/2027	633 400	(30 567)	(0,05)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,955	04/10/2027	141 800	(6 523)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2030	2 179 420	63 299	0,10
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	710 885	22 496	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	07/09/2027	69 900	(3 016)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	69 900	(3 016)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	06/09/2032	104 600	(4 504)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,080	23/02/2053	29 400	(538)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	70 000	(2 804)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	2 045 860	60 887	0,09
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,300	06/03/2033	54 100	(1 279)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,340	23/02/2030	86 000	(2 133)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,350	14/12/2032	28 200	847	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,370	01/03/2033	52 300	(886)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,400	23/02/2033	49 800	(735)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,405	01/03/2033	53 700	(758)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,420	24/05/2033	88 200	(824)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,425	01/03/2033	53 900	(695)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,430	27/02/2033	53 600	(664)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,450	07/03/2033	109 100	(1 184)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	102 500	(1 720)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	21/06/2026	195 110	4 168	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/06/2030	175 800	(1 569)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/05/2033	5 163 180	(14 692)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	21/06/2033	117 200	(81)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	37 900	(523)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,610	12/12/2032	56 700	478	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,700	06/06/2033	3 050 720	(7 502)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	13/12/2027	141 600	2 564	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	104 800	(867)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,040	20/06/2024	364 200	(2 763)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,060	20/06/2024	1 457 000	(10 772)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,140	22/06/2024	607 100	(4 008)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,500	22/05/2025	11 396 340	(48 351)	(0,08)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,900	06/06/2025	6 663 690	(3 156)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	5,100	22/05/2024	22 102 670	(24 246)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	5,400	06/06/2024	12 921 420	11 269	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,140	02/01/2025	BRL 26 500	(93)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,160	02/01/2025	17 600	(60)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,220	04/01/2027	32 000	66	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,245	04/01/2027	16 100	36	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,260	04/01/2027	16 200	37	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,350	02/01/2025	21 800	(56)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,700	04/01/2027	8 300	42	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,715	04/01/2027	35 900	187	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,870	04/01/2027	85 800	529	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,000	02/01/2025	59 500	21	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,080	02/01/2025	98 900	71	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,140	02/01/2025	49 800	49	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,145	02/01/2025	48 800	49	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,160	02/01/2025	99 600	107	0,00
À recevoir	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,000	16/06/2047	CAD 2 600	693	0,00
À recevoir	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,300	16/06/2047	2 500	638	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	3,400	20/06/2029	6 300	(712)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/07/2023	\$ 212 800	(2 853)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	18/07/2023	157 300	(2 110)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	26/07/2023	154 700	(2 075)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/08/2023	7 957 500	(109 160)	(0,17)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	09/08/2023	22 000	301	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	06/09/2023	344 400	(4 843)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	15/09/2023	324 000	4 596	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	16/09/2023	1 456 600	20 933	0,03
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	16/09/2023	33 800	(486)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	30/09/2023	1 155 100	16 136	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/09/2023	3 594 237	(46 794)	(0,07)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,550	15/07/2023	4 567 800	48 659	0,08
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,674	05/08/2023	62 900	666	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,678	29/07/2023	65 200	681	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,711	28/07/2023	69 000	683	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,715	27/07/2023	200 000	1 978	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/09/2023	3 358 883	(41 837)	(0,06)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,800	15/07/2023	1 479 300	13 903	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,928	06/08/2023	150 100	1 667	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,975	17/09/2023	52 200	594	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,990	24/09/2023	75 000	866	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/09/2023	120 615	1 425	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,035	28/09/2023	25 900	298	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,144	04/08/2023	49 600	(538)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,215	13/07/2023	83 500	(861)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,235	12/08/2023	75 400	817	0,00

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	LIBOR USD à 3 mois	1,250 %	15/09/2023	\$ 1 654 500	\$ (18 300)	(0,03)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,280	24/09/2023	423 400	(3 210)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,306	02/08/2023	48 000	496	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,350	20/07/2023	109 100	721	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	20/07/2023	91 400	600	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	15/08/2023	387 430	2 659	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,370	19/07/2023	61 300	401	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,405	07/09/2023	154 300	1 095	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,418	20/07/2023	71 900	(451)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,420	24/08/2023	269 100	1 801	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,425	18/07/2023	146 000	(915)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	16/07/2023	137 000	841	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	17/08/2023	361 600	2 327	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,485	13/07/2023	78 100	(462)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	05/07/2023	89 100	(851)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	12/07/2023	85 443	490	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/09/2023	473 684	(4 943)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/07/2023	43 100	(249)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	15/07/2023	88 600	(845)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	22/07/2023	59 100	(565)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,545	26/07/2023	58 900	(561)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,550	20/07/2023	485 100	(2 721)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	11/07/2023	121 400	(657)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	12/07/2023	76 200	(410)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,580	16/08/2023	150 400	(866)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,595	13/07/2023	82 600	(443)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,600	15/08/2023	1 549 700	(8 778)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	20/07/2023	60 000	(313)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/07/2023	72 000	(378)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,650	24/08/2023	897 000	(4 975)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,655	24/07/2023	72 000	(370)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	12/07/2023	310 700	(1 469)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	17/08/2023	1 446 200	(7 503)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,735	12/07/2023	57 800	(263)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,785	12/08/2023	76 100	384	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,815	24/07/2023	14 400	(62)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,867	26/07/2023	14 400	(58)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,945	23/09/2023	127 800	1 211	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	18/08/2023	133 700	(521)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,008	09/08/2023	36 700	134	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	2,750	17/06/2026	AUD 72 880	(2 076)	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,000	21/03/2027	1 179 040	(54 438)	(0,08)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,250	17/12/2024	197 200	(8 816)	(0,01)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,500	17/06/2025	361 600	(21 281)	(0,03)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	17/12/2024	97 200	(8 686)	(0,01)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,750	18/06/2024	124 400	(13 332)	(0,02)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,150	18/03/2030	€ 907 700	18 200	0,03
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,150	17/06/2030	244 000	2 942	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,294	30/06/2026	6 200	743	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,329	30/12/2025	13 200	1 407	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,363	30/06/2025	20 500	1 805	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,395	30/12/2024	10 800	771	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,425	28/06/2024	24 600	1 171	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,453	29/12/2023	25 200	662	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,500	17/06/2050	126 900	59 328	0,09
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	331 900	(35 249)	(0,05)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	113 000	(11 846)	(0,02)
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052	1 064 900	51 697	0,08
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	243 100	(22 803)	(0,04)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	116 300	(10 904)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	21/09/2027	355 500	(21 251)	(0,03)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	2,000	17/09/2024	149 000	20 973	0,03
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,000	21/09/2032	170 580	(18 124)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	11/04/2024	197 900	(3 100)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	13/04/2024	407 800	(6 402)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	17/05/2024	183 200	(3 101)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	26/04/2024	200 100	(2 777)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	184 600	(2 748)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	184 500	(2 757)	0,00
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	300	7	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	127 800	(2 839)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,165	06/09/2032	MXN 266 600	(917)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,360	21/08/2037	285 500	(639)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	7,380	14/08/2037	111 200	6	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,480	18/06/2037	337 300	(1 175)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,495	14/01/2032	2 373 500	(5 253)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,498	15/01/2032	5 192 600	(11 416)	(0,02)
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,498	19/06/2037	810 000	(2 774)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,103	04/01/2038	3 750 800	(1 347)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	8,280	28/11/2036	690 000	(3 180)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	8,310	28/11/2036	1 066 400	(5 047)	(0,01)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,410	31/03/2027	1 182 800	514	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 recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,660 %	04/04/2024	MXN 2 723 700	\$ 3 031	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,675	03/04/2024	9 876 200	10 940	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,701	31/03/2032	905 900	(1 914)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,730	06/04/2027	787 600	(55)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,732	30/03/2032	394 000	(875)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,750	05/04/2024	1 956 500	2 097	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	4,000	15/09/2031	£ 53 800	(10 126)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,020	15/10/2031	69 900	(12 663)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,055	15/09/2031	49 800	(9 273)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,066	15/09/2031	96 800	(16 301)	(0,03)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,140	15/10/2031	135 400	(22 552)	(0,04)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,250	15/11/2031	135 600	(19 058)	(0,03)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,400	15/10/2031	60 700	(8 777)	(0,01)
					\$ 639 520	0,99
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 862 397	1,34

- (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.

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
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	\$ 818	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	8 769	0,02
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	6 963	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	17 142	0,03
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,053	20/07/2023	869 400	5 216	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,053	20/07/2023	869 400	5 216	19 130	0,03
	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	1 478	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	6 521	13 486	0,02
	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	2 299	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	15 638	0,03
	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	5 676	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	12 620	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	8 179	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	14 861	0,02
							\$ 113 886	\$ 127 059	0,20

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 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	158 300	\$ (491)	\$ (17)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	158 300	(491)	(2 141)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,380	31/07/2023	61 300	(236)	(292)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	61 300	(236)	(180)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	40 100	(263)	(100)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	40 100	(263)	(31)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,060	14/07/2023	22 800	(166)	(102)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,360	14/07/2023	22 800	(166)	(54)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	30 200	(97)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	30 200	(97)	(32)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	37 100	(253)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	37 100	(253)	(1)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	25 600	(83)	(52)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	25 600	(83)	(124)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	30 700	(71)	(59)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	30 700	(71)	(108)	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 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)	\$ (49)	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)	(764)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,765	25/07/2023	377 400	(2 359)	(10)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,765	25/07/2023	377 400	(2 359)	(9 382)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,468	25/07/2023	79 800	(1 907)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,468	25/07/2023	79 800	(1 907)	(5 016)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	96 700	(595)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	96 700	(595)	(2 075)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	77 900	(504)	(10)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	77 900	(504)	(1 586)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	77 500	(544)	(12)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	77 500	(544)	(1 487)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	77 500	(539)	(13)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	77 500	(539)	(1 451)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	77 500	(538)	(13)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	77 500	(538)	(1 426)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	77 700	(534)	(10)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	77 700	(534)	(1 611)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	77 400	(530)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	77 400	(530)	(1 688)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	77 800	(564)	(15)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	77 800	(564)	(1 503)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	78 600	(522)	(14)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	78 600	(522)	(1 632)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	155 600	(564)	(14)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	155 600	(564)	(2 024)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	155 600	(543)	(13)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	155 600	(543)	(2 156)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	159 200	(497)	(21)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	159 200	(497)	(1 993)	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)	(294)	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)	(4 569)	(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)	(100)	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)	(1 446)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	51 300	(167)	(103)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	51 300	(167)	(248)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	30 700	(73)	(59)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	30 700	(73)	(108)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	28 600	(101)	(11)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	10/07/2023	28 600	(101)	(18)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,250	20/07/2023	64 100	(219)	(81)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	64 100	(219)	(266)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,050	19/07/2023	377 000	(2 262)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,050	19/07/2023	377 000	(2 262)	(8 346)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,052	20/07/2023	376 700	(2 317)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,052	20/07/2023	376 700	(2 317)	(8 299)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,700	19/07/2023	79 700	(1 857)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,700	19/07/2023	79 700	(1 857)	(4 210)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,675	20/07/2023	81 100	(1 885)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,675	20/07/2023	81 100	(1 886)	(4 362)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	82 900	(560)	(16)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	82 900	(560)	(1 746)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	30 200	(97)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	30 200	(97)	(32)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	28 600	(99)	(11)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	10/07/2023	28 600	(99)	(18)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	58 300	(193)	(104)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	58 300	(193)	(240)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,550	19/07/2023	20 300	(1 464)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,550	19/07/2023	20 300	(1 464)	(2 397)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,537	20/07/2023	20 300	(1 478)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,537	20/07/2023	20 300	(1 478)	(2 443)	(0,01)
							\$ (56 121)	\$ (78 879)	(0,12)

OPTIONS À TAUX D'INTERÊT PLAFONNÉ

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 plancher à 2 ans hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 2 ans	0,022	08/08/2026	291 100	\$ (5 021)	\$ (9 419)	(0,02)	
	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)	(1 529)	0,00	
MYC	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 1 an	0,030	24/07/2024	869 400	(6 506)	(19 151)	(0,03)	
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 1 an	0,030	24/07/2024	869 400	(6 506)	(231)	0,00	
	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 1 an	0,026	23/07/2025	869 400	(7 615)	(13 872)	(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)	(1 972)	0,00	
	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 2 ans	0,026	23/07/2026	616 200	(10 898)	(17 481)	(0,03)	
	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)	(4 082)	(0,01)	
							\$ (60 079)	\$ (67 737)	(0,11)

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
MSC	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security TBA 4,000 % éch. 01/07/2053	\$ 93,281	06/07/2023	18 600	\$ (74)	\$ (18)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security TBA 4,500 % éch. 01/08/2053	95,875	07/08/2023	59 000	(350)	(344)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security TBA 4,500 % éch. 01/08/2053	97,875	07/08/2023	59 000	(323)	(83)	0,00
					\$ (747)	\$ (445)	0,00

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

⁽²⁾ Cet instrument sous-jacent a une date d'entrée en vigueur différée.

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
BOA	HSBC Holdings PLC	(1,000) %	20/06/2024	€ 1 300	\$ 22	\$ (29)	\$ (7)	0,00
	UBS AG	(1,000)	20/06/2024	\$ 19 300	1 254	(1 288)	(34)	0,00
BPS	UBS AG	(1,000)	20/06/2024	7 000	458	(471)	(13)	0,00
					\$ 1 734	\$ (1 788)	\$ (54)	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)	\$ 47	\$ (194)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	60 500	(4 393)	4 124	(269)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	10 800	(998)	786	(212)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	23 000	(2 501)	1 605	(896)	0,00
BPS	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	14 700	(705)	258	(447)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	2 900	(259)	131	(128)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	17 900	(1 564)	1 484	(80)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	4 000	(287)	131	(156)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2025	1 300	(223)	149	(74)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	7 070	(658)	519	(139)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	84 600	(11 485)	8 189	(3 296)	(0,01)
BYL	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	22 450	(1 502)	1 402	(100)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	15 260	(1 322)	728	(594)	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	168 400	(2 908)	4 399	1 491	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2024	10 000	(102)	148	46	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2024	29 600	116	(31)	85	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	42 900	(1 989)	1 098	(891)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	10 600	(381)	58	(323)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	52 400	(847)	1 269	422	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2026	31 000	(203)	627	424	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	12 600	(1 154)	906	(248)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	4 700	(490)	307	(183)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	176 800	(2 751)	4 316	1 565	0,01
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	32 600	(488)	591	103	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	17 600	(687)	151	(536)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	8 200	(731)	369	(362)	0,00
	Equinix, Inc.	5,000	20/06/2027	9 000	1 258	(103)	1 155	0,00
	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/06/2028	22 200	82	63	145	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	60 300	(502)	1 141	639	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	2 400	(101)	110	9	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2028	10 500	(179)	169	(10)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	8 700	(449)	461	12	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2025	10 200	(565)	392	(173)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	4 800	(215)	45	(170)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	37 500	(3 786)	3 049	(737)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	58 600	(6 583)	4 300	(2 283)	0,00
HUS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2023	30 100	(953)	1 082	129	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2024	187 100	(5 474)	6 873	1 399	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2024	32 400	(94)	245	151	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	2 200	(101)	55	(46)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	3 500	(135)	28	(107)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2026	33 200	(259)	713	454	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	37 600	(2 111)	2 163	52	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	2 200	(151)	141	(10)	0,00
MBC	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	6 200	(676)	434	(242)	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	21 700	(781)	121	(660)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	24 900	(2 220)	1 120	(1 100)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	47 400	(418)	920	502	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2025	5 300	(73)	144	71	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2026	56 100	(326)	1 092	766	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2026	44 400	68	426	494	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2027	40 600	(137)	490	353	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2028	97 700	(2 227)	2 132	(95)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	124 200	(5 441)	1 051	(4 390)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	12 500	(1 123)	1 067	(56)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	17 500	(1 945)	1 601	(344)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	4 600	(518)	339	(179)	0,00
					\$ (74 888)	\$ 65 625	\$ (9 263)	(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	\$ 704	\$ (243)	\$ 194	\$ (49)	0,00
	Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25/05/2046	31 672	(8 014)	6 751	(1 263)	0,00
BRC	Indice CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11/05/2063	199	0	0	0	0,00
	Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25/05/2046	2 491	(628)	529	(99)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16/12/2072	100 000	(1 840)	340	(1 500)	0,00
CBK	Indice CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11/05/2063	1 371	(47)	46	(1)	0,00
	Indice PRIMEX.ARM.2-AAA Index	4,580	25/12/2037	204	9	(7)	2	0,00
	Indice CDX.HY-33 à 5 ans 35-100 %	5,000	20/12/2024	57 942	9 646	(5 556)	4 090	0,01
DUB	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	232 645	(4 705)	3 756	(949)	0,00
FBF	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	512 161	(3 542)	(30)	(3 572)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	162 200	(1 133)	(661)	(1 794)	0,00
GST	Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25/05/2046	817	(195)	162	(33)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	1 176 350	(15 149)	10 370	(4 779)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	912 039	2 357	(8 718)	(6 361)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16/12/2072	86 300	(1 494)	199	(1 295)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18/11/2064	473 700	(13 687)	1 126	(12 561)	(0,02)
JPS	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	171 400	(2 957)	2 261	(696)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	171 700	(1 351)	153	(1 198)	0,00
MEI	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	45 500	(336)	(167)	(503)	0,00
MYC	Indice CDX.HY-33 à 5 ans 35-100 %	5,000	20/12/2024	117 250	19 538	(11 260)	8 278	0,01
	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	66 700	(1 419)	1 148	(271)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	364 800	(3 092)	547	(2 545)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	923 900	(14 119)	3 901	(10 218)	(0,02)
	Indice CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16/12/2072	379 100	507	(6 194)	(5 687)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500	16/12/2072	171 300	(4 147)	610	(3 537)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18/11/2064	74 400	(631)	(1 342)	(1 973)	0,00
	Indice CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11/05/2063	119	(4)	4	0	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	810 495	(7 907)	4 615	(3 292)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	152 400	(785)	(278)	(1 063)	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	1 386 500	(13 793)	(1 541)	(15 334)	(0,02)
	Indice CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16/12/2072	88 800	0	(1 332)	(1 332)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	15 500	(445)	382	(63)	0,00
					\$ (69 606)	\$ 8	\$ (69 598)	(0,11)

⁽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	07/2023	AUD	\$ 213 693	\$ 141 807	\$ 0	\$ (438)	\$ (438)	0,00
	07/2023	\$	25 308	AUD 38 671	433	0	433	0,00
BOA	08/2023		141 919	213 693	439	0	439	0,00
	07/2023	BRL	1 092 872	\$ 227 682	1 133	0	1 133	0,00
	07/2023	CAD	50 220	36 908	0	(1 044)	(1 044)	0,00
	07/2023	DKK	47 744	7 022	26	0	26	0,00
	07/2023	€	2 892 903	3 109 146	13	(47 026)	(47 013)	(0,07)
	07/2023	£	1 889	2 402	1	0	1	0,00
	07/2023	KRW	21 404 093	16 374	109	0	109	0,00
	07/2023	\$	239 615	AUD 367 256	4 849	0	4 849	0,01
	07/2023		649	CLP 518 135	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023		426	CNH 3 027	0	(10)	(10)	0,00
	07/2023		3 802	DKK 26 327	56	0	56	0,00
	07/2023		15 458	€ 14 291	134	0	134	0,00
	07/2023		51 760	£ 40 973	331	0	331	0,00
	07/2023		253 509	MXN 4 667 108	17 934	0	17 934	0,03
	07/2023		83 019	NZD 136 836	813	0	813	0,00
	08/2023	¥	30 501 508	\$ 221 212	8 429	0	8 429	0,01
	08/2023	\$	226 521	BRL 1 092 872	0	(1 073)	(1 073)	0,00
	08/2023		7 022	DKK 47 665	0	(26)	(26)	0,00
	08/2023		390	MXN 7 203	27	0	27	0,00
	08/2023		12 844	ZAR 234 981	0	(459)	(459)	0,00
09/2023	¥	39 652 000	\$ 285 475	7 888	0	7 888	0,01	
09/2023	TWD	863 392	28 441	662	0	662	0,00	
09/2023	\$	931	HKD 7 275	0	(1)	(1)	0,00	
09/2023		105 297	IDR 1 576 294 578	0	(600)	(600)	0,00	
09/2023		132 840	KRW 168 303 768	0	(4 569)	(4 569)	(0,01)	

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	
BPS	07/2023	AUD	153 451	\$ 101 641	\$ 0	\$ (503)	0,00	
	07/2023	BRL	168 074	35 015	174	0	0,00	
	07/2023	CAD	499 877	376 836	0	(929)	0,00	
	07/2023	CHF	246	272	0	(4)	0,00	
	07/2023	€	3 722	4 057	0	(3)	0,00	
	07/2023	£	398	493	0	(14)	0,00	
	07/2023	¥	7 371 900	52 044	1 039	0	1 039	0,00
	07/2023	KRW	3 203 677	2 451	17	0	17	0,00
	07/2023	PEN	82 193	22 546	0	(117)	(117)	0,00
	07/2023	SGD	187	140	2	0	2	0,00
	07/2023	\$	4 060	AUD 6 168	45	0	45	0,00
	07/2023		4 216	CHF 3 771	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023		20 507	CLP 16 201 315	0	(332)	(332)	0,00
	07/2023		26 343	€ 24 142	25	(29)	(4)	0,00
	07/2023		38 885	£ 30 363	1	(284)	(283)	0,00
	07/2023		278	HKD 2 178	0	0	0	0,00
	07/2023		1 151 501	¥ 159 985 622	0	(44 604)	(44 604)	(0,07)
	08/2023	CHF	3 760	\$ 4 216	1	0	1	0,00
	08/2023	CNH	8 475	1 227	58	0	58	0,00
	08/2023	COP	20 000 000	4 360	0	(354)	(354)	0,00
	08/2023	KRW	213 185 465	162 578	579	(19)	560	0,00
	08/2023	TWD	432 158	14 155	276	0	276	0,00
	08/2023	\$	101 721	AUD 153 451	505	0	505	0,00
	08/2023		34 837	BRL 168 074	0	(165)	(165)	0,00
	08/2023		135 610	INR 11 141 683	48	(8)	40	0,00
	08/2023		22 511	PEN 82 193	107	0	107	0,00
	08/2023	ZAR	229 830	\$ 12 435	318	0	318	0,00
	09/2023	\$	118 895	IDR 1 786 694 261	0	(217)	(217)	0,00
	09/2023		528	ZAR 9 322	0	(38)	(38)	0,00
	10/2023	ZAR	522 082	\$ 28 114	770	0	770	0,00
BRC	07/2023	£	6 757	8 512	0	(79)	(79)	0,00
	07/2023	¥	15 387 000	118 964	12 298	0	12 298	0,02
	07/2023	KRW	21 587 029	16 519	115	0	115	0,00
	07/2023	NZD	78 426	47 799	0	(249)	(249)	0,00
	07/2023	SGD	15	11	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	38 034	£ 30 440	701	(35)	666	0,00
	07/2023		1 937	NZD 3 227	40	0	40	0,00
	08/2023	CNH	131	\$ 18	0	0	0	0,00
	08/2023	\$	1 646	MXN 28 479	1	0	1	0,00
	08/2023	ZAR	894 917	\$ 46 825	193	(535)	(342)	0,00
	09/2023	IDR	3 139 928	210	1	0	1	0,00
	09/2023	ILS	64	18	1	0	1	0,00
	09/2023	¥	27 972 000	204 352	8 969	0	8 969	0,01
CBK	07/2023	AUD	10 499	7 024	35	0	35	0,00
	07/2023	BRL	394 739	82 540	712	0	712	0,00
	07/2023	£	13 976	17 721	0	(47)	(47)	0,00
	07/2023	IDR	417 441	28	0	0	0	0,00
	07/2023	MXN	49 303	2 733	0	(135)	(135)	0,00
	07/2023	PEN	127 411	35 084	0	(66)	(66)	0,00
	07/2023	\$	89 474	AUD 137 137	1 811	0	1 811	0,00
	07/2023		400 000	BRL 2 135 280	42 638	0	42 638	0,07
	07/2023		100 194	CLP 80 278 146	251	(477)	(226)	0,00
	07/2023		3 115 519	€ 2 865 917	11 223	(26)	11 197	0,02
	07/2023		50 484	£ 39 884	280	(58)	222	0,00
	07/2023		28	IDR 417 441	0	0	0	0,00
	07/2023		320	MXN 5 671	10	0	10	0,00
	07/2023		34 291	PEN 127 411	859	0	859	0,00
	08/2023	€	2 817 994	\$ 3 068 045	0	(10 597)	(10 597)	(0,02)
	08/2023	¥	71 217 564	516 797	19 973	0	19 973	0,03
	08/2023	SEK	15 788	1 557	92	0	92	0,00
	08/2023	TWD	449 925	14 739	290	0	290	0,00
	08/2023	\$	437 502	BRL 2 199 716	16 948	(673)	16 275	0,03
	08/2023		63 477	CLP 51 055 978	1	(108)	(107)	0,00
	08/2023		466	CNH 3 248	0	(18)	(18)	0,00
	08/2023		534	MXN 9 251	1	0	1	0,00
	08/2023		114 988	NOK 1 199 469	0	(2 860)	(2 860)	0,00
	09/2023	IDR	417 955	\$ 28	0	0	0	0,00
	09/2023	KRW	21 517 513	16 645	246	0	246	0,00
	09/2023	\$	1 902	BRL 9 226	0	(10)	(10)	0,00
	10/2023		14 756	CLP 11 980 971	1	0	1	0,00
	10/2023		200 000	MXN 3 916 040	23 930	0	23 930	0,04
DUB	07/2023	PEN	158 620	\$ 43 368	0	(391)	(391)	0,00
	07/2023	\$	1 833	MXN 31 671	11	(1)	10	0,00
	07/2023		87 024	PEN 317 240	473	0	473	0,00
	09/2023	IDR	1 238 338	\$ 83	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	10/2023	ZAR	2 514 760	\$ 138 092	\$ 6 359	\$ 0	0,01
	07/2023	SGD	188	139	0	0	0,00
GLM	07/2023	BRL	1 354 467	281 902	1 125	0	0,00
	07/2023	KRW	8 481 662	6 489	44	0	0,00
	07/2023	PEN	31 209	8 594	0	(16)	0,00
	07/2023	SGD	202	150	0	0	0,00
	07/2023	\$	400 000	BRL 2 015 920	17 895	0	0,03
	07/2023		44 567	MXN 781 574	926	0	0,00
	07/2023		8 419	PEN 31 209	191	0	0,00
	08/2023	KRW	101 892 293	\$ 77 472	40	(5)	0,00
	08/2023	\$	481 902	BRL 2 420 037	18 083	(756)	0,03
	08/2023		209 090	INR 17 176 866	48	(10)	0,00
	08/2023		50 557	NOK 536 418	0	(412)	0,00
	09/2023		193 351	BRL 985 646	8 700	0	0,01
	10/2023		200 000	978 170	0	(428)	0,00
	10/2023	ZAR	1 302 045	\$ 69 404	1 210	0	0,00
	12/2023	\$	100 000	MXN 1 976 800	11 841	0	0,02
IND	07/2023		106	CHF 95	0	0	0,00
	07/2023		11 168	DKK 77 371	169	0	0,00
	08/2023	CHF	95	\$ 106	0	0	0,00
	08/2023	CNH	3 096	437	10	0	0,00
	08/2023	\$	129 819	NOK 1 360 581	0	(2 629)	0,00
	09/2023	SGD	160	\$ 120	1	0	0,00
	10/2023	\$	50 000	CLP 40 510 000	0	(105)	0,00
JPM	07/2023	BRL	159 689	\$ 33 352	249	0	0,00
	07/2023	€	9 700	10 371	0	(212)	0,00
	07/2023	¥	52 876 771	369 735	3 895	0	0,01
	07/2023	SGD	21	16	0	0	0,00
	07/2023	\$	199 512	AUD 305 169	3 624	0	0,01
	07/2023		2 887 881	£ 2 283 993	15 875	0	0,02
	07/2023		47 793	NZD 78 426	254	0	0,00
	07/2023		3 095	SGD 4 089	0	(72)	0,00
	08/2023	CNH	6 803	\$ 984	46	0	0,00
	08/2023	£	2 283 993	2 888 493	0	(15 844)	(0,02)
	08/2023	¥	44 860 928	325 232	12 275	0	0,02
	08/2023	KRW	17 967 504	13 620	0	(35)	0,00
	08/2023	NZD	78 426	47 789	0	(253)	0,00
	08/2023	\$	33 178	BRL 159 689	0	(236)	0,00
	08/2023		369 735	¥ 52 652 083	0	(3 909)	(0,01)
	08/2023		4 258	MXN 73 786	9	0	0,00
	08/2023		18 647	NOK 197 799	0	(156)	0,00
	08/2023		6 321	ZAR 115 680	0	(222)	0,00
	08/2023	ZAR	1 103	\$ 60	2	0	0,00
	09/2023	ILS	61	17	1	0	0,00
	09/2023	INR	48 517	589	0	(1)	0,00
	09/2023	KRW	59 788 491	45 977	410	0	0,00
	09/2023	\$	43 890	IDR 660 353 220	0	(27)	0,00
	09/2023		155 203	PEN 571 459	1 504	0	0,00
	09/2023		7 527	SGD 10 067	0	(67)	0,00
	10/2023	MXN	25 116	\$ 1 430	0	(6)	0,00
	12/2023	\$	142 392	INR 11 750 563	0	(48)	0,00
MBC	07/2023	CAD	588	\$ 446	1	0	0,00
	07/2023	€	49 858	53 381	0	(1 014)	0,00
	07/2023	£	5 419	6 753	0	(136)	0,00
	07/2023	HKD	210	27	0	0	0,00
	07/2023	¥	18 330 650	140 245	13 061	0	0,02
	07/2023	\$	1 219	CAD 1 624	9	0	0,00
	07/2023		57 554	€ 53 577	898	0	0,00
	07/2023		3 220	£ 2 518	0	(18)	0,00
	07/2023		16 598	¥ 2 307 528	0	(633)	0,00
	08/2023	CNH	18	\$ 3	0	0	0,00
	08/2023	\$	1 042	¥ 150 015	0	0	0,00
	09/2023	¥	76 717 000	\$ 558 840	22 465	0	0,04
	09/2023	SGD	250	185	0	0	0,00
	09/2023	\$	244 638	KRW 311 986 429	0	(6 861)	(0,01)
	09/2023		1 492	ZAR 26 404	0	(105)	0,00
MYI	09/2023	ZAR	2 863 258	\$ 158 281	7 762	0	0,01
	07/2023	AUD	1 999	1 320	0	(11)	0,00
	07/2023	CHF	8	9	0	0	0,00
	07/2023	DKK	42 580	6 242	3	0	0,00
	07/2023	€	4 088	4 443	0	(17)	0,00
	07/2023	£	2 441 459	3 034 406	0	(69 547)	(0,11)
	07/2023	HKD	3 038	388	0	0	0,00
	07/2023	IDR	415 530 265	27 785	69	0	0,00
	07/2023	¥	208 879	1 450	4	0	0,00
	07/2023	SGD	106	78	0	0	0,00
	07/2023	\$	6	CHF 6	0	0	0,00
	07/2023		13 002	€ 11 973	61	0	0,00
	07/2023		21 457	£ 17 100	295	(12)	0,00
	07/2023		27 654	IDR 415 530 265	62	0	0,00
	07/2023		1 442	MXN 24 667	0	(6)	0,00
	07/2023		5 499	NZD 9 086	67	0	0,00
	08/2023	CNH	54	\$ 8	0	0	0,00
	08/2023	TWD	2 979 497	97 795	2 111	0	0,00
	08/2023	\$	6 242	DKK 42 509	0	(3)	0,00
	08/2023		13 995	ZAR 256 162	0	(491)	0,00
	09/2023	INR	10 479	\$ 127	0	0	0,00
	09/2023	KRW	115 786 160	89 152	907	0	0,00
	09/2023	\$	92 368	IDR 1 380 399 373	0	(677)	0,00
	09/2023		273 981	KRW 350 622 323	0	(6 759)	(0,01)

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	
RBC	07/2023	AUD	8 679	\$ 5 907	\$ 130	\$ 130	0,00	
	07/2023	\$	23 907	£ 18 701	0	(131)	0,00	
	07/2023		98 948	MXN 1 903 869	11 869	0	11 869	0,02
	08/2023	CNH	17	\$ 2	0	0	0	0,00
	08/2023	MXN	1 127 071	65 036	0	(151)	(151)	0,00
RYL	07/2023	€	1 678	1 808	0	(23)	(23)	0,00
	07/2023	\$	1 337	€ 1 244	21	0	21	0,00
	08/2023	CNH	228	\$ 32	1	0	1	0,00
SCX	07/2023	AUD	313 874	208 362	0	(568)	(568)	0,00
	07/2023	CHF	4 869	5 419	0	(23)	(23)	0,00
	07/2023	£	182	229	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$	281 491	AUD 430 779	5 257	0	5 257	0,01
	07/2023		1 631	CHF 1 472	15	0	15	0,00
	07/2023		2 025	£ 1 611	23	0	23	0,00
	07/2023		216 376	NZD 356 375	1 958	0	1 958	0,00
	08/2023	CNH	9 131	\$ 1 329	70	0	70	0,00
	08/2023	TWD	2 858 469	93 610	1 812	0	1 812	0,00
	08/2023	\$	208 527	AUD 313 874	570	0	570	0,00
	09/2023	INR	30 343	\$ 368	0	0	0	0,00
	09/2023	KRW	21 299 463	16 478	245	0	245	0,00
	09/2023	TWD	1 829 480	60 356	1 492	0	1 492	0,00
	09/2023	\$	266 068	IDR 3 979 243 703	0	(1 753)	(1 753)	0,00
	09/2023	ZAR	2 911 476	\$ 165 943	13 000	0	13 000	0,02
SOG	07/2023	SGD	1 011	757	9	0	9	0,00
	07/2023	\$	167 144	AUD 255 470	2 910	0	2 910	0,00
	07/2023		610	MXN 10 505	1	0	1	0,00
SSB	07/2023	BRL	981 358	\$ 205 305	1 873	0	1 873	0,00
	07/2023	¥	6 905 000	52 360	4 398	0	4 398	0,01
	07/2023	KRW	15 865 393	12 136	80	0	80	0,00
	07/2023	PEN	40 902	11 214	0	(64)	(64)	0,00
	08/2023	\$	58 419	CLP 47 366 236	420	0	420	0,00
	08/2023		11 198	PEN 40 902	58	0	58	0,00
	09/2023		205 305	BRL 992 239	0	(1 902)	(1 902)	0,00
	12/2023		14 516	INR 1 198 078	0	(3)	(3)	0,00
TOR	07/2023	AUD	386 268	\$ 255 130	0	(1 989)	(1 989)	0,00
	07/2023	NZD	919 425	559 622	0	(3 664)	(3 664)	(0,01)
	07/2023	\$	88 423	AUD 135 193	1 568	0	1 568	0,00
	07/2023		28 649	CAD 37 874	0	(27)	(27)	0,00
	07/2023		13 271	CLP 10 677 797	26	0	26	0,00
	08/2023	CAD	37 859	\$ 28 649	27	0	27	0,00
	08/2023	\$	255 338	AUD 386 268	1 987	0	1 987	0,00
	08/2023		307 832	NZD 505 524	1 840	0	1 840	0,00
	09/2023	¥	37 377 000	\$ 265 270	3 359	0	3 359	0,01
UAG	07/2023	AUD	615 721	411 139	2 143	(859)	1 284	0,00
	07/2023	CHF	317	353	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	¥	21 417 510	148 480	298	0	298	0,00
	07/2023	\$	20 259	AUD 30 946	340	0	340	0,00
	07/2023		104	CHF 93	0	0	0	0,00
	07/2023		1 756	MXN 31 255	64	0	64	0,00
	08/2023	CHF	93	\$ 104	0	0	0	0,00
	08/2023	TWD	5 284	172	3	0	3	0,00
	08/2023	\$	411 463	AUD 615 721	858	(2 140)	(1 282)	0,00
	08/2023		1 021	CNH 7 080	0	(45)	(45)	0,00
	08/2023		148 480	¥ 21 327 249	0	(299)	(299)	0,00
	08/2023	ZAR	528 356	\$ 27 528	8	(329)	(321)	0,00
	09/2023	SGD	10 128	7 579	73	0	73	0,00
	10/2023	ZAR	810 416	43 773	1 320	0	1 320	0,00
					\$ 402 033	\$ (244 950)	\$ 157 083	0,24

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de capitalisation, 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	07/2023	AUD	142 486	\$ 94 554	\$ 0	\$ (292)	0,00	
	07/2023	\$	181 023	AUD 276 642	3 123	0	3 123	0,00
	08/2023		94 628	142 486	293	0	293	0,00
BOA	07/2023	AUD	5 090	\$ 3 429	45	(3)	42	0,00
	07/2023	\$	548 809	AUD 844 643	13 428	0	13 428	0,02
BPS	07/2023	AUD	791 945	\$ 524 092	6	(3 073)	(3 067)	0,00
	07/2023	\$	27 205	AUD 41 197	294	(76)	218	0,00
	08/2023		490 001	739 189	2 433	0	2 433	0,00
CBK	07/2023	AUD	6 862	\$ 4 659	91	0	91	0,00
	07/2023	\$	114 677	AUD 175 699	2 302	(25)	2 277	0,00
JPM	07/2023		173 071	264 725	3 143	0	3 143	0,01
MBC	07/2023	AUD	1 034	\$ 682	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	\$	676	AUD 1 012	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07/2023	AUD	239	\$ 160	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
RBC	07/2023	\$ 2 744	AUD 4 091	\$ 22	\$ (43)	\$ (21)	0,00
SCX	07/2023	AUD 251 342	\$ 166 851	0	(455)	(455)	0,00
	07/2023	\$ 140 802	AUD 215 394	2 585	(10)	2 575	0,00
	08/2023	166 983	251 342	456	0	456	0,00
TOR	07/2023	AUD 438 850	\$ 289 861	0	(2 260)	(2 260)	0,00
	07/2023	\$ 291 092	AUD 445 062	5 163	0	5 163	0,01
	08/2023	290 097	438 850	2 257	0	2 257	0,00
UAG	07/2023	AUD 851 261	\$ 565 239	1 092	(2 494)	(1 402)	0,00
	07/2023	\$ 212 567	AUD 324 703	3 572	0	3 572	0,01
	08/2023	564 773	849 912	2 497	(1 075)	1 422	0,00
				\$ 42 803	\$ (9 814)	\$ 32 989	0,05

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 109 069	BRL 544 314	\$ 3 766	\$ 0	\$ 3 766	0,01
BPS	07/2023	BRL 275 714	\$ 57 657	546	(43)	503	0,00
	07/2023	\$ 52 327	BRL 261 027	1 783	0	1 783	0,00
	08/2023	56 683	272 175	0	(536)	(536)	0,00
CBK	07/2023	BRL 510 099	\$ 106 469	903	(176)	727	0,00
	07/2023	\$ 47 727	BRL 238 973	1 811	0	1 811	0,00
	08/2023	103 227	496 204	0	(866)	(866)	0,00
GLM	07/2023	45 344	227 206	1 755	0	1 755	0,00
JPM	07/2023	BRL 239 272	\$ 49 886	343	(57)	286	0,00
	07/2023	\$ 49 272	BRL 246 620	1 852	0	1 852	0,01
	08/2023	BRL 604	\$ 124	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$ 45 382	BRL 218 435	0	(322)	(322)	0,00
MBC	08/2023	4 472	21 488	0	(39)	(39)	0,00
TOR	07/2023	BRL 493 055	\$ 102 773	565	0	565	0,00
	08/2023	\$ 102 237	BRL 493 055	0	(525)	(525)	0,00
				\$ 13 324	\$ (2 565)	\$ 10 759	0,02

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	CAD 1 701	\$ 1 287	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	07/2023	\$ 49 183	CAD 66 923	1 391	0	1 391	0,01
CBK	07/2023	2 425	3 305	72	0	72	0,00
JPM	07/2023	49 354	66 956	1 246	0	1 246	0,00
MBC	07/2023	CAD 2 100	\$ 1 549	0	(37)	(37)	0,00
	07/2023	\$ 1 098	CAD 1 446	2	(7)	(5)	0,00
MYI	07/2023	CAD 643	\$ 485	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07/2023	\$ 49 515	CAD 67 248	1 305	0	1 305	0,00
TOR	07/2023	CAD 120 226	\$ 90 741	38	(153)	(115)	0,00
	08/2023	\$ 90 741	CAD 120 178	153	(37)	116	0,00
				\$ 4 208	\$ (235)	\$ 3 973	0,01

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	CHF 9	\$ 10	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 166	CHF 149	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	CHF 199 684	\$ 223 269	74	(4)	70	0,00
	07/2023	\$ 296 735	CHF 268 459	3 336	0	3 336	0,01
	08/2023	222 609	198 524	0	(75)	(75)	0,00
IND	07/2023	CHF 105 227	\$ 117 145	0	(472)	(472)	0,00
	08/2023	\$ 117 145	CHF 104 928	472	0	472	0,00
JPM	07/2023	CHF 195	\$ 215	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07/2023	1 827	2 033	0	(9)	(9)	0,00
	07/2023	\$ 2 210	CHF 1 985	9	0	9	0,00
MYI	07/2023	CHF 7 783	\$ 8 598	0	(102)	(102)	0,00
	07/2023	\$ 110	CHF 98	0	0	0	0,00
RBC	07/2023	CHF 101	\$ 113	0	0	0	0,00
RYL	07/2023	481	535	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07/2023	511	566	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	\$ 211 312	CHF 189 869	916	0	916	0,00
UAG	07/2023	CHF 205 721	\$ 229 492	0	(454)	(454)	0,00
	07/2023	\$ 191 473	CHF 172 045	831	0	831	0,00
	08/2023	229 299	204 962	451	0	451	0,00
				\$ 6 089	\$ (1 125)	\$ 4 964	0,01

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Au 30 juin 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	Devises à livrer	Devises à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	07/2023	\$ 5 539 572	€ 5 154 449	\$ 83 940	\$ (6)	\$ 83 934	0,14
BPS	07/2023	€ 5 241 939	\$ 5 743 533	24 584	(8)	24 576	0,04
	07/2023	\$ 5 555 993	€ 5 167 844	82 265	(139)	82 126	0,13
	08/2023	\$ 5 739 183	€ 5 230 568	0	(24 818)	(24 818)	(0,04)
CBK	07/2023	€ 5 314 554	\$ 5 774 992	0	(23 188)	(23 188)	(0,04)
	07/2023	\$ 11 003	€ 10 073	14	(27)	(13)	0,00
	08/2023	\$ 5 548 601	€ 5 096 379	19 164	0	19 164	0,03
JPM	07/2023	€ 5 241 978	\$ 5 723 716	4 716	0	4 716	0,01
	07/2023	\$ 320 901	€ 300 141	6 553	0	6 553	0,01
	08/2023	\$ 5 731 721	€ 5 241 978	0	(4 889)	(4 889)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 46 018	\$ 49 593	27	(640)	(613)	0,00
	07/2023	\$ 63 244	€ 58 317	462	(82)	380	0,00
MYI	07/2023	\$ 9 346	€ 8 614	51	0	51	0,00
SOG	07/2023	\$ 5 532 365	€ 5 142 849	78 484	0	78 484	0,12
				\$ 300 260	\$ (53 797)	\$ 246 463	0,39

Au 30 juin 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	Devises à livrer	Devises à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	07/2023	\$ 9 474	£ 7 464	\$ 18	\$ (3)	\$ 15	0,00
BPS	07/2023	£ 974	\$ 1 248	10	0	10	0,00
	07/2023	\$ 434 812	£ 351 538	12 115	0	12 115	0,02
BRC	07/2023	£ 7 159	\$ 8 959	0	(143)	(143)	0,00
	07/2023	\$ 1 265	£ 1 000	8	(1)	7	0,00
CBK	07/2023	£ 2 601	\$ 3 286	0	(21)	(21)	0,00
	07/2023	\$ 40 201	£ 31 592	22	(58)	(36)	0,00
JPM	07/2023	£ 364 569	\$ 460 961	0	(2 534)	(2 534)	0,00
	08/2023	\$ 461 059	£ 364 569	2 529	0	2 529	0,00
MBC	07/2023	\$ 439 868	£ 355 209	11 750	(23)	11 727	0,02
MYI	07/2023	\$ 431 151	£ 346 901	9 883	0	9 883	0,01
TOR	07/2023	£ 364 830	\$ 463 590	0	(237)	(237)	0,00
	08/2023	\$ 463 691	£ 364 830	229	0	229	0,00
				\$ 36 564	\$ (3 020)	\$ 33 544	0,05

Au 30 juin 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	Devises à livrer	Devises à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	07/2023	\$ 141	¥ 19 630	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
BOA	07/2023	\$ 24 410	¥ 3 393 259	0	(933)	(933)	0,00
BRC	07/2023	\$ 1 055	¥ 151 776	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07/2023	\$ 11 669	¥ 1 638 095	0	(336)	(336)	0,00
DUB	07/2023	\$ 2 748	¥ 383 597	0	(94)	(94)	0,00
MBC	07/2023	¥ 3 575 966	\$ 24 767	26	0	26	0,00
	07/2023	\$ 10 427	¥ 1 456 723	0	(348)	(348)	0,00
	08/2023	\$ 24 767	¥ 3 560 848	0	(27)	(27)	0,00
MYI	07/2023	\$ 6 459	¥ 902 963	0	(212)	(212)	0,00
RYL	07/2023	¥ 284 515	\$ 2 045	77	0	77	0,00
	07/2023	\$ 173	¥ 24 165	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07/2023	\$ 24 902	¥ 3 464 161	0	(935)	(935)	0,00
				\$ 103	\$ (2 900)	\$ (2 797)	0,00

Au 30 juin 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	07/2023	NOK 4 462	\$ 411	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	07/2023	\$ 140 743	NOK 1 564 935	5 328	0	5 328	0,01
CBK	07/2023	NOK 31 270	\$ 2 815	0	(104)	(104)	0,00
	07/2023	\$ 68 872	NOK 774 477	3 417	0	3 417	0,01
GLM	07/2023	NOK 636 799	\$ 59 081	0	(358)	(358)	(0,01)
	08/2023	\$ 59 062	NOK 635 974	360	0	360	0,00
MBC	07/2023	NOK 242	\$ 23	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	\$ 2 931	¥ 270	0	(3)	(3)	0,00
RYL	07/2023	\$ 4 976	¥ 462	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07/2023	\$ 104	¥ 10	0	0	0	0,00
				\$ 9 105	\$ (473)	\$ 8 632	0,01

Au 30 juin 2023, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories 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		
BOA	07/2023	\$	33 616	CNH	238 750	\$ 0	\$ (797)	\$ (797)	0,00
BPS	07/2023		33 699		238 605	0	(900)	(900)	0,00
BRC	07/2023		142		999	0	(4)	(4)	0,00
GLM	07/2023	CNH	260 830	\$	35 958	104	0	104	0,00
	07/2023	\$	33 897	CNH	239 120	0	(1 028)	(1 028)	(0,01)
	08/2023		35 958		260 233	0	(109)	(109)	0,00
IND	07/2023		3 444		24 689	0	(51)	(51)	0,00
MBC	07/2023	CNH	1 391	\$	195	4	0	4	0,00
	07/2023	\$	3 174	CNH	22 602	0	(67)	(67)	0,00
SOG	07/2023		42		302	0	0	0	0,00
UAG	07/2023		1 383		9 878	0	(25)	(25)	0,00
						\$ 108	\$ (2 981)	\$ (2 873)	(0,01)

Au 30 juin 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		
BRC	07/2023	\$	1 203 525	SGD	1 628 515	\$ 0	\$ (203)	\$ (203)	0,00
GLM	07/2023	SGD	29 937	\$	22 295	174	0	174	0,00
	07/2023	\$	94 561	SGD	127 132	0	(623)	(623)	0,00
JPM	07/2023	SGD	1 796 588	\$	1 327 659	147	0	147	0,00
	07/2023	\$	240 098	SGD	324 957	15	0	15	0,00
	08/2023		1 327 659		1 794 862	0	(104)	(104)	0,00
MBC	07/2023		1 169 359		1 579 966	2	(1 913)	(1 911)	(0,01)
	08/2023		13 614		18 390	0	(12)	(12)	0,00
MYI	07/2023	SGD	1 747 700	\$	1 293 388	2 024	(24)	2 000	0,00
	07/2023	\$	237	SGD	321	0	0	0	0,00
	08/2023		1 274 199		1 720 131	0	(1 918)	(1 918)	0,00
UAG	07/2023		1 286 081		1 739 540	0	(722)	(722)	0,00
						\$ 2 362	\$ (5 519)	\$ (3 157)	(0,01)

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 390 663 0,61

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. 01/07/2053 (l)	\$ 33 900	\$ (29 360)	(0,04)
2,500 % éch. 01/08/2053	33 900	(29 382)	(0,05)
3,500 % éch. 01/07/2053 (l)	12 900	(11 908)	(0,02)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (70 650)	(0,11)
Total des Investissements		\$ 84 767 863	131,37
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (20 240 296)	(31,37)
Actifs nets		\$ 64 527 567	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.

^ 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) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2023 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

(m) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,97 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Chester A PLC 0,000 % éch. 17/03/2046	18/04/2019	\$ 12 844	\$ 15 221	0,02
Chester A PLC 0,000 % éch. 20/05/2046	18/04/2019	17 298	5 711	0,01
Chester A PLC 5,702 % éch. 17/03/2046	18/04/2019	67 109	65 956	0,10
Chester A PLC 6,152 % éch. 17/03/2046	18/04/2019	19 159	18 645	0,03
Chester A PLC 6,652 % éch. 17/03/2046	18/04/2019	17 790	17 191	0,03
Chester A PLC 7,152 % éch. 17/03/2046	18/04/2019	10 947	10 491	0,02
Chester A PLC 7,902 % éch. 17/03/2046	18/04/2019	5 473	5 163	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	10/06/2022	353	353	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. « D » - Exp. 10/06/2071	10/06/2022	0	0	0,00
Corestate Capital Holding S.A., 15,000 % éch. 31/07/2023	06/12/2022	1 050	1 102	0,00
Deutsche Bank AG 2,129 % éch. 24/11/2026	11/01/2023	21 934	21 631	0,03
Deutsche Bank AG 3,035 % éch. 28/05/2032	25/05/2021 - 29/09/2021	46 076	36 192	0,06
Intelsat Emergence S.A.	19/06/2017 - 23/02/2022	440 150	106 931	0,16
Morgan Stanley 0,000 % éch. 02/04/2032	11/02/2020	59 946	42 809	0,07
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25/09/2020	37 976	179 237	0,28
Oracle Corp. 3,950 % éch. 25/03/2051	22/03/2021	16 942	12 841	0,02
Oracle Corp. 4,100 % échéance 25/03/2061	22/03/2021 - 05/10/2021	26 506	18 545	0,03
Sierra Hamilton Holder LLC	31/07/2017	500	0	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC	08/12/2014 - 19/12/2019	1 691	374	0,00
		\$ 786 506	\$ 552 682	0,86

(n) Des titres d'une juste valeur globale de 16 137 \$ (31 décembre 2022 : 19 079 \$) 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 30 juin 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 1 729 845 \$ (31 décembre 2022 : 1 599 431 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 147 325 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 247 863	\$ 78 047 527	\$ 723 095	\$ 79 018 485
Fonds d'investissement	2 484 042	0	0	2 484 042
Contrats de mise en pension	0	2 090 601	0	2 090 601
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	4 935	1 241 892	(1 442)	1 245 385
Titres vendus à découvert	0	(70 650)	0	(70 650)
Totaux	\$ 2 736 840	\$ 81 309 370	\$ 721 653	\$ 84 767 863

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 30 juin 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	2,000 %	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (4 716)	\$ (5 159)	(0,01)
MBC	4,650	30/06/2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (3 161)	(3 161)	0,00
Total des Contrats de prise en pension					\$ (8 320)	(0,01)

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 3 553	\$ (2 760)	\$ 793	\$ 2 601	\$ (920)	\$ 1 681
BOA	87 921	(72 150)	15 771	(36 145)	30 410	(5 735)
BOM	S/O	S/O	S/O	(1 847)	2 130	283
BPS	53 184	(37 570)	15 614	37 581	(31 520)	6 061
BRC	15 698	(13 344)	2 354	(19 965)	16 765	(3 200)
BSH	S/O	S/O	S/O	(15)	0	(15)
BYL	(694)	0	(694)	(1 443)	0	(1 443)
CBK	111 321	(102 271)	9 050	63 317	(64 234)	(917)
CLY	S/O	S/O	S/O	29	0	29
DUB	5 408	(4 210)	1 198	(21 446)	18 530	(2 916)
FAR	(1 361)	1 570	209	(2 129)	2 290	161
FBF	(5 366)	6 053	687	(4 557)	4 715	158
GLM	40 729	(21 620)	19 109	(618)	(8 230)	(8 848)
GST	(25 672)	28 106	2 434	(18 731)	8 496	(10 235)
HUS	1 679	(1 680)	(1)	1 179	(520)	659
IND	(2 605)	3 310	705	S/O	S/O	S/O
JPM	29 658	(25 510)	4 148	9 738	(8 970)	768
JPS	(1 894)	2 090	196	(1 195)	1 120	(75)
MBC	44 257	(38 610)	5 647	112 677	(90 850)	21 827
MEI	(503)	576	73	(363)	294	(69)
MSC	(18)	0	(18)	S/O	S/O	S/O
MYC	(16 280)	36 980	20 700	(9 537)	(29 220)	(38 757)
MYI	(64 245)	45 110	(19 135)	44 132	(35 730)	8 402
RBC	11 696	(11 670)	26	(1 592)	2 500	908
RYL	65	0	65	(10 431)	8 200	(2 231)
SAL	(21 448)	23 530	2 082	(15 988)	16 088	100
SCX	25 953	(20 680)	5 273	122 133	(112 350)	9 783
SOG	81 404	(59 920)	21 484	10	0	10
SSB	4 860	(5 020)	(160)	S/O	S/O	S/O
TOR	8 320	(8 420)	(100)	1 135	(920)	215
UAG	5 043	0	5 043	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	59,20	68,71
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	63,14	45,07
Autres valeurs mobilières	0,11	2,21
Fonds d'investissement	3,85	3,59
Contrats de mise en pension	3,24	5,90
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,01)	0,15
Instruments financiers dérivés compensés	1,34	2,09
Instruments financiers dérivés hors cote	0,61	0,37
Titres vendus à découvert	(0,11)	(1,27)
Contrats de prise en pension	(0,01)	(0,03)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	2,54	3,66
Obligations et billets privés	18,55	22,63
Obligations et billets convertibles	0,03	0,03
Obligations et billets municipaux	0,13	0,15
Agences du gouvernement américain	51,65	35,26
Obligations du Trésor américain	20,40	17,94
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	11,83	12,73
Titres adossés à des actifs	7,67	8,72
Émissions souveraines	3,35	5,29
Actions ordinaires	0,65	0,93
Droits	0,01	0,01
Bons de souscription	0,05	0,07
Titres privilégiés	0,20	0,23
Sociétés d'investissement immobilier	0,29	0,34
Instruments à court terme	5,10	8,00
Fonds d'investissement	3,85	3,59
Contrats de mise en pension	3,24	5,90
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,06	0,16
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,07)	(0,01)

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
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 - achat de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,32	0,41
Swaps de taux d'intérêt	0,99	1,68
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,20	0,21
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,12)	(0,17)
Options à taux d'intérêt plafonné	(0,11)	(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	(0,11)	(0,06)
Swaps de rendement total sur indices	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,24	(0,26)
Contrats de change à terme couverts	0,52	0,82
Titres vendus à découvert	(0,11)	(1,27)
Autres actifs et passifs à court terme	(31,37)	(26,82)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	ACTIONS (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust 5,705 % éch. 25/01/2036	\$ 900	\$ 695	0,71	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,500 % éch. 01/03/2026	CLP 50 000	\$ 61	0,06	ACTIONS ORDINAIRES
New Century Home Equity Loan Trust 5,885 % éch. 25/10/2035	700	571	0,58	Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,750 % éch. 12/10/2110	\$ 100	89	0,09	SERVICES DE COMMUNICATION
Structured Asset Investment Loan Trust 6,125 % éch. 25/05/2035	711	610	0,62	6,350 % éch. 09/02/2035	200	211	0,22	Intelsat Emergence S.A. (a)(f)
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,440 % éch. 25/07/2036 ^	667	634	0,65	10,000 % éch. 05/12/2024	MXN 10 000	579	0,59	DROITS
		5 394	5,52	Obligation internationale du gouvernement roumain 3,750 % éch. 07/02/2034	€ 220	195	0,20	Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Obligation internationale du gouvernement russe 5,250 % éch. 23/06/2047 ^	\$ 200	12	0,01	Total des Valeurs mobilières
Obligation internationale du gouvernement argentin 0,500 % éch. 09/07/2030	160	53	0,06	Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 5 560	306	0,31	FONDS D'INVESTISSEMENT
1,500 % éch. 09/07/2035	179	54	0,06	Obligation internationale du gouvernement turc 5,250 % éch. 13/03/2030	\$ 1 000	823	0,84	ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF
3,500 % éch. 09/07/2041	272	88	0,09	5,750 % éch. 11/05/2047	250	171	0,18	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)
3,875 % éch. 09/01/2038	63	22	0,02			2 664	2,73	763 914
								7 607
								7,78
								Total des Fonds d'investissement
								\$ 7 607
								7,78

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 septembre	Long	09/2023	1	\$ (1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	24	(22)	(0,02)
				\$ (23)	(0,02)

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	\$ 98,000	15/12/2023	1	\$ (1)	\$ 0	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	1	(1)	(5)	(0,01)
				\$ (2)	\$ (5)	(0,01)

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ (28) (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 - 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 à 5 ans	1,000 %	20/12/2026	\$ 644	\$ 20	0,02
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	1 500	23	0,02
Indice CDX.EM-39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	700	14	0,01
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	5,000	20/06/2028	6 400	153	0,16
				\$ 210	0,21

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	\$ 8	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2028	490 000	(63)	(0,06)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,200	15/12/2041	30 000	(1)	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	40 000	3	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/06/2051	\$ 450	117	0,12
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	21/12/2052	800	(23)	(0,03)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,350	17/01/2025	900	21	0,02
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	3 800	62	0,06
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	1 750	(13)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	9 850	336	0,34
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	24 900	(729)	(0,75)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,610	12/12/2032	100	1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/09/2023	450	5	0,01
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	11/04/2024	€ 100	(2)	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	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100 %	13/04/2024	€ 200	\$ (3)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	17/05/2024	100	(2)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	100	(2)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	100	(2)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	100	(2)	0,00
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	400	(1)	0,00
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	1 100	(8)	(0,01)
					\$ (298)	(0,30)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (88)	(0,09)

(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.

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 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	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	3,650	01/12/2023	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	3,200	06/07/2023	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	3,650	06/07/2023	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	2,920	13/10/2023	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	2,920	13/10/2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	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)	(2)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	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	2,920	13/10/2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	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	3,018	20/10/2023	100	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	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	3,140	23/10/2023	100	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	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	3,190	23/10/2023	100	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	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	3,225	23/10/2023	100	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	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	2,973	25/10/2023	100	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	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	2,841	27/10/2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	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	3,088	03/11/2023	100	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	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	2,910	10/11/2023	100	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	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	3,750	17/11/2023	100	0	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	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	3,650	20/11/2023	100	0	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	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	3,750	07/12/2023	100	1	(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	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)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	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	10/07/2023	100	0	0	0,00
							\$ (20)	\$ (30)	(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
MYC	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000 %	20/12/2026	\$ 200	\$ (9)	\$ 2	\$ (7)	(0,01)

Tableau des investissements Fonds Income Fund II (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 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	07/2023	AUD	136	\$	89	\$ 0	0,00
BOA	07/2023	MXN	19 278		1 100	0	(0,02)
	08/2023	\$	1 997	AUD	2 958	0	(0,03)
	08/2023		38	CNY	264	0	0,00
	08/2023		315	NZD	497	0	(0,01)
	09/2023	TWD	2 442	\$	80	2	0,00
	09/2023	\$	126	HKD	988	0	0,00
	09/2023		161	KRW	204 490	0	(0,01)
BPS	07/2023	HKD	107	\$	14	0	0,00
	07/2023	\$	140	AUD	212	1	0,00
	08/2023	AUD	212	\$	141	0	(0,00)
	08/2023	CNH	274		40	2	0,00
	08/2023	TWD	1 222		40	1	0,00
	08/2023	\$	20	CNY	139	0	(0,00)
	08/2023		352	MXN	6 135	2	0,00
	09/2023		16	IDR	246 803	0	0,00
	10/2023	ZAR	5 836	\$	314	8	0,01
	12/2023	MXN	1 256		70	0	(0,00)
BRC	08/2023	€	4 259		4 652	0	0,00
	08/2023	£	8 440		10 561	0	(0,17)
	09/2023	HKD	1 110		142	0	0,00
	09/2023	IDR	1 279		0	0	0,00
CBK	07/2023	BRL	964		195	0	(0,00)
	07/2023	\$	75	BRL	365	1	0,00
	07/2023		328	CLP	265 479	2	0,00
	07/2023		1 016	MXN	19 561	122	0,13
	08/2023	£	196	\$	244	0	(0,01)
	08/2023	TWD	1 176		39	1	0,00
	08/2023	\$	51	BRL	265	3	0,00
	08/2023		573	¥	76 124	0	(0,04)
	09/2023	KRW	2 005	\$	2	0	0,00
	09/2023	\$	1	IDR	9 188	0	0,00
DUB	07/2023		1 192	BRL	6 457	147	0,15
	07/2023	BRL	6 398	\$	1 315	0	(0,01)
GLM	07/2023	\$	97	BRL	521	11	0,01
	09/2023	TWD	4 269	\$	140	3	0,00
	09/2023	\$	1 226	BRL	5 984	1	0,00
	10/2023		135	MXN	2 363	1	0,00
MBC	08/2023	CNH	188	\$	27	1	0,00
	09/2023	\$	297	KRW	379 065	0	(0,01)
MYI	07/2023	AUD	197	\$	131	0	0,00
	07/2023	€	480		523	0	0,00
	07/2023	£	33		42	0	0,00
	07/2023	IDR	82 509		5	0	0,00
	07/2023	\$	6	IDR	82 509	0	0,00
	08/2023	€	63	\$	68	0	(0,00)
	08/2023	TWD	1 326		44	1	0,00
	08/2023	\$	1 058	¥	140 541	0	(0,08)
	09/2023	IDR	82 581	\$	6	0	0,00
	09/2023	KRW	1 000 285		766	4	0,00
	09/2023	\$	26	IDR	393 464	0	0,00
SCX	09/2023		333	KRW	426 008	0	(0,01)
	08/2023	AUD	386	\$	256	1	0,00
	08/2023	CNH	322		47	2	0,00
	08/2023	¥	22 300		162	7	0,01
	08/2023	NZD	687		418	0	(0,00)
	08/2023	\$	57	CNY	389	0	(0,00)
	08/2023		110	NZD	176	0	(0,00)
	09/2023	TWD	2 040	\$	67	1	0,00
	09/2023	\$	661	IDR	9 830 878	0	(0,01)
SSB	07/2023	CLP	265 860	\$	331	0	0,00
	08/2023	\$	331	CLP	266 628	0	0,00
	09/2023		753	BRL	3 820	30	0,03
UAG	07/2023	AUD	109	\$	71	0	(0,00)
	07/2023	\$	22	AUD	34	0	0,00
	08/2023	AUD	34	\$	22	0	0,00
	08/2023	ZAR	512		27	0	0,00
						\$ 355	(0,07)
						\$ (427)	
						\$ (72)	

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	\$ 538	\$ 357	\$ 0	\$ (1)	0,00	
	07/2023	\$	668	AUD 1 021	11	0	0,01	
	08/2023		357	538	1	1	0,00	
BOA	07/2023		2 217	3 402	51	(3)	0,05	
BPS	07/2023	AUD	\$ 3 019	\$ 1 999	0	(12)	(0,01)	
	07/2023	\$	1 781	AUD 2 745	46	0	0,05	
	08/2023		1 855	2 798	9	0	0,01	
CBK	07/2023		426	653	9	0	0,01	
SCX	07/2023	AUD	\$ 949	\$ 630	0	(2)	0,00	
	07/2023	\$	515	AUD 788	10	0	0,01	
	08/2023		631	949	2	0	0,00	
UAG	07/2023	AUD	\$ 3 222	\$ 2 139	4	(9)	(0,01)	
	07/2023	\$	795	AUD 1 214	13	0	0,01	
	08/2023		2 141	3 222	9	(4)	0,01	
					\$ 165	\$ (31)	\$ 134	0,14

Au 30 juin 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	
AZD	07/2023	\$	520	€ 476	\$ 0	\$ 0	0,00	
BOA	07/2023	€	5	\$ 5	0	0	0,00	
	07/2023	\$	1 389	€ 1 292	21	0	0,02	
BPS	07/2023	€	1 502	\$ 1 646	7	0	0,01	
	07/2023	\$	1 387	€ 1 290	21	0	0,02	
	08/2023		1 615	1 472	0	(7)	(0,01)	
BRC	07/2023		323	300	4	0	0,00	
CBK	07/2023	€	1 695	\$ 1 842	0	(7)	(0,01)	
	07/2023	\$	217	€ 200	1	0	0,00	
	08/2023		1 781	1 636	6	0	0,01	
MBC	07/2023		100	93	2	0	0,00	
SCX	07/2023		1 408	1 316	27	0	0,03	
					\$ 89	\$ (14)	\$ 75	0,07

Au 30 juin 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	07/2023	£	354	\$ 445	\$ 0	\$ (5)	(0,01)	
	07/2023	\$	3 039	£ 2 400	12	0	0,01	
BPS	07/2023		3 352	£ 2 710	94	0	0,10	
BRC	07/2023		197	158	4	0	0,01	
CBK	07/2023	£	62	\$ 79	0	0	0,00	
	07/2023	\$	242	£ 192	2	0	0,00	
MBC	07/2023		3 338	£ 2 697	90	0	0,09	
MYI	07/2023		3 360	2 703	77	0	0,08	
					\$ 279	\$ (5)	\$ 274	0,28

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 374 0,38

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			
3,500 % éch. 01/08/2053	\$ 200	\$ (182)	(0,19)
5,000 % éch. 01/08/2053	200	(196)	(0,20)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (378)	(0,39)
Total des Investissements		\$ 102 378	104,77
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (4 661)	(4,77)
Actifs nets		\$ 97 717	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.

Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

- (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) Affilié au Fonds.
- (e) Titre convertible conditionnel.
- (f) 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	\$ 21	0,02

Un montant en numéraire de 1 541 \$ (31 décembre 2022 : 961 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 141 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 94 643	\$ 248	\$ 94 891
Fonds d'investissement	7 607	0	0	7 607
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(1)	259	0	258
Titres vendus à découvert	0	(378)	0	(378)
Totaux	\$ 7 606	\$ 94 524	\$ 248	\$ 102 378

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 9	\$ 0	\$ 9	\$ 3	\$ 0	\$ 3
BOA	9	0	9	(65)	0	(65)
BPS	169	(260)	(91)	(73)	0	(73)
BRC	(167)	90	(77)	(5)	0	(5)
CBK	86	0	86	24	0	24
DUB	143	0	143	(2)	0	(2)
GLM	(19)	20	1	(36)	30	(6)
MBC	85	0	85	22	0	22
MYC	(7)	31	24	(8)	31	23
MYI	(6)	0	(6)	(10)	0	(10)
SCX	30	0	30	27	0	27
SSB	30	0	30	S/O	S/O	S/O
UAG	12	0	12	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	49,90	55,36
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	47,21	45,23
Autres valeurs mobilières	0,01	0,03
Fonds d'investissement	7,78	3,07
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,03)	0,00

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,09)	0,76
Instruments financiers dérivés hors cote	0,38	(0,21)
Titres vendus à découvert	(0,39)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,95	1,71
Obligations et billets privés	12,35	12,97
Agences du gouvernement américain	36,16	19,84
Obligations du Trésor américain	22,45	35,05
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	16,94	17,43
Titres adossés à des actifs	5,52	10,35
Émissions souveraines	2,73	3,23
Actions ordinaires	0,02	0,04
Droits	0,00	0,00
Fonds d'investissement	7,78	3,07
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,02)	0,01
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	(0,01)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,21	0,28
Swaps de taux d'intérêt	(0,30)	0,48
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,03)	(0,08)
Options sur titres	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,01)	(0,01)
Contrats de change à terme	(0,07)	(0,27)
Contrats de change à terme couverts	0,49	0,15
Titres vendus à découvert	(0,39)	S/O
Autres actifs et passifs à court terme	(4,77)	(4,24)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset Fund

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				ÉMISSIONS SOUVERAINES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				1211 Avenue of the Americas Trust				Obligation internationale du gouvernement australien			
BANQUE ET FINANCE				3,901 % éch. 10/08/2035				0,250 % éch. 21/11/2032 AUD			
Bank of America Corp.				1 900				2 804			
5,875 % éch. 15/03/2028 (c) \$				1 770				1 636			
Jyske Realkredit A/S				Banc of America Alternative Loan Trust				0,750 % éch. 21/11/2027			
1,000 % éch. 01/10/2050 DKK				6,000 % éch. 25/06/2046				3,000 % éch. 30/09/2025			
6 512				183				718			
687				161				464			
0,21				0,05				832			
1,500 % éch. 01/10/2053				Banc of America Funding Trust				Obligation à rendement réel du gouvernement canadien			
4 978				3,825 % éch. 20/01/2047				0,500 % éch. 01/12/2050 (b) CAD			
533				199				241			
0,16				0,05				146			
2,500 % éch. 01/10/2047				6,000 % éch. 25/03/2034				1,250 % éch. 01/12/2047 (b)			
1				64				2 219			
0,00				0,02				1 608			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				Bear Stearns Mortgage Funding Trust				Obligation internationale du gouvernement danois			
1,000 % éch. 01/10/2050				5,340 % éch. 25/01/2037				0,100 % éch. 15/11/2023 (b) DKK			
0				2 803				3 548			
0				2 546				521			
0,00				0,79				Obligation internationale du gouvernement français			
1,000 % éch. 01/10/2053				CityLine Commercial Mortgage Trust				0,100 % éch. 01/03/2028 (b) €			
14				2 475				932			
1,000 % éch. 01/10/2053				2,871 % éch. 10/11/2031				1 988			
13 395				2 475				2 109			
1,000 % éch. 01/10/2053				Countrywide Alternative Loan Trust				0,100 % éch. 25/07/2031 (b)			
200				6,000 % éch. 25/04/2037				976			
23				98				992			
0,01				0,03				1 597			
2,500 % éch. 01/10/2047				HarborView Mortgage Loan Trust				1,800 % éch. 25/07/2040 (b)			
0				6,057 % éch. 20/06/2035				42			
0,00				50				55			
Nykredit Realkredit A/S				JPMorgan Mortgage Trust				Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
1,000 % éch. 01/10/2050				4,195 % éch. 25/06/2035				0,100 % éch. 15/05/2033 (b)			
8 352				0				6 264			
879				0,00				5 752			
0,27				New Residential Mortgage Loan Trust				0,400 % éch. 15/05/2030 (b)			
1,000 % éch. 01/10/2053				4,500 % éch. 25/05/2058				2 253			
298				143				2 249			
0,01				136				0,69			
1,500 % éch. 01/10/2053				One Market Plaza Trust				1,400 % éch. 26/05/2025 (b)			
25 770				3,614 % éch. 10/02/2032				10 325			
2 743				2 000				11 154			
0,85				1 852				3,44			
2,000 % éch. 01/10/2053				Polaris PLC				2,350 % éch. 15/09/2024 (b)			
495				5,640 % éch. 23/10/2059				1 176			
57				374				1 291			
0,02				472				0,40			
2,500 % éch. 01/10/2047				Sequoia Mortgage Trust				2,600 % éch. 15/09/2023 (b)			
3				5,557 % éch. 20/07/2036				560			
0,00				150				610			
3,500 % éch. 01/10/2053				Towd Point Mortgage Trust				Obligation internationale du gouvernement japonais			
2 372				3,500 % éch. 25/01/2058				0,005 % éch. 10/03/2031 (b) ¥			
318				2 230				21 143			
0,10				2 044				157			
Realkredit Danmark A/S				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				0,100 % éch. 10/03/2024 (b)			
1,000 % éch. 01/10/2050				4,163 % éch. 25/09/2033				0,100 % éch. 10/03/2028 (b)			
3 161				1				960 531			
333				5,810 % éch. 25/01/2045				1 662 205			
0,10				185				12 173			
1,000 % éch. 01/10/2053				6,170 % éch. 25/08/2045				Obligation internationale du gouvernement espagnol			
580				1 717				0,650 % éch. 30/11/2027 (b) €			
59				13 583				11 646			
0,02				4,19				1 760			
1,500 % éch. 01/10/2050				TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				1,450 % éch. 31/10/2023			
11 102				Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				300			
1 175				5,930 % éch. 25/05/2034				0,125 % éch. 10/08/2028 (b) £			
0,36				52				320			
2,500 % éch. 01/04/2047				Asset-Backed Funding Certificates Trust				0,125 % éch. 10/08/2031 (b)			
2				5,750 % éch. 25/10/2034				1 904			
0,00				34				2353			
8 438				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				0,125 % éch. 22/11/2036 (b)			
2,60				5,368 % éch. 25/02/2036				172			
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				CIT Mortgage Loan Trust				377			
Petrobras Global Finance BV				6,500 % éch. 25/10/2037				427			
7,250 % éch. 17/03/2044 \$				16				1 878			
157				92				0,58			
155				Citigroup Mortgage Loan Trust				0,125 % éch. 22/03/2039 (b)			
0,05				5,440 % éch. 25/09/2036				377			
Total des Obligations et billets privés				Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				1 690			
8 593				6,095 % éch. 25/10/2034				615			
2,65				145				657			
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				Bon du Trésor britannique			
Freddie Mac				5,330 % éch. 25/06/2047				0,125 % éch. 10/08/2041 (b)			
5,593 % éch. 15/06/2047				2 048				0,125 % éch. 22/03/2044 (b)			
681				1 913				320			
657				0,59				2 353			
0,20				Encore Credit Receivables Trust				0,125 % éch. 10/08/2041 (b)			
Ginnie Mae				6,050 % éch. 25/01/2036				141			
3,858 % éch. 20/08/2068				900				80			
94				847				0,02			
92				First Franklin Mortgage Loan Trust				5,460 % éch. 25/07/2036			
0,03				5,460 % éch. 25/07/2036				150			
5,866 % éch. 20/08/2072				5,930 % éch. 25/09/2035				141			
2 039				80				0,04			
2 033				0,02				Home Equity Asset Trust			
0,63				6,020 % éch. 25/09/2035				6,005 % éch. 25/08/2034			
5,966 % éch. 20/10/2072 - 20/01/2073				131				128			
8 786				19				0,04			
8 724				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				5,470 % éch. 25/05/2037			
2,69				5,470 % éch. 25/07/2036				1 675			
5,966 % éch. 20/10/2072 - 20/01/2073				1 675				1 638			
300				0,51				0,01			
300				0,01				OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
0,09				Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (b)				0,125 % éch. 15/04/2025			
1 889				0,125 % éch. 15/04/2026				2 114			
1 908				0,125 % éch. 15/04/2026				2 011			
0,59				0,125 % éch. 15/07/2026				2 114			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniformes (UMBS), TBA				0,125 % éch. 15/07/2026				2 776			
4 000 % éch. 01/08/2053				0,125 % éch. 15/07/2026				190			
14 900				0,125 % éch. 15/10/2026				13 653			
13 996				0,125 % éch. 15/04/2027				752			
4,32				0,125 % éch. 15/01/2030				118			
15 600				0,125 % éch. 15/01/2030				118			
15 006				0,125 % éch. 15/07/2030				473			
4,63				0,125 % éch. 15/07/2030				425			
5 800				0,125 % éch. 15/07/2031				12 562			
5 687				0,125 % éch. 15/01/2032				11 145			
1,75				0,125 % éch. 15/01/2032				9 519			
3 900				0,125 % éch. 15/02/2051				8 385			
3 881				0,125 % éch. 15/02/2051				701			
1,20				0,125 % éch. 15/02/2052				0,22			
4 600				0,125 % éch. 15/02/2052				654			
4 694				0,250 % éch. 15/02/2050				434			
1,45				0,250 % éch. 15/02/2050				83			
56 978				0,375 % éch. 15/01/2027				118			
17,58				0,375 % éch. 15/01/2027				18			
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				0,375 % éch. 15/07/2027				1 756			
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (b)				10 887				0,54			
0,125 % éch. 15/04/2025				0,500 % éch. 15/04/2024				10 208			
2 114				1 323				3,15			
2 011				2 828				0,40			
0,62				2 646				0,82			
0,80				588				0,18			
0,05				128				0,04			
0,125 % éch. 15/07/2026				0,625 % éch. 15/01/2024				578			
190				0,625 % éch. 15/01/2026				122			
13 653				0,625 % éch. 15/07/2032				122			
12 767				0,625 % éch. 15/07/2032				6 159			
3,94				0,625 % éch. 15/02/2043				5 664			
0,21				0,750 % éch. 15/07/2028				1,75			
0,02				0,750 % éch. 15/02/2042				13			
0,125 % éch. 15/01/2030				0,750 % éch. 15/02/2042				11			
118				0,750 % éch. 15/02/2042				0,00			
106				0,750 % éch. 15/02/2045				0,64			
0,03				1 417				0,18			
425				1 172				0,36			
0,13				0,00				0,00			
12 562				0,00				0,00			
11 145				0,00				0,00			
3,44				0,00				0,00			
9 519				0,00				0,00			
8 385				0,00				0,00			
2,59				0,00				0,00			
0,22				0,00				0,00			
654				0,00				0,00			
434				0,00				0,00			
0,13				0,00				0,00			
0,250 % éch. 15/02/2050				0,00				0,00			
118				0,00				0,00			
83				0,00				0,00			
0,03				0,00				0,00			
1 871				0,00				0,00			
1 756				0,00				0,00			
0,54				0,00				0,00			
10 887				0,00				0,00			
10 208				0,00				0,00			
3,15				0,00				0,00			
0,40				0,00				0,00			
0,82				0,00				0,00			
588				0,00				0,00			
128</											

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset 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 billet du gouvernement australien à 3 ans septembre	Court	09/2023	8	\$ 3	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Court	09/2023	1	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Court	09/2023	51	71	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	2	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	49	49	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Long	09/2023	119	(134)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	53	(108)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Court	09/2023	7	5	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	693	652	0,20
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	26	(96)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Court	09/2023	11	26	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	120	241	0,07
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	196	(227)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	147	163	0,05
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Court	09/2023	85	5	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	71	(117)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Long	09/2023	60	(80)	(0,02)
				<u>\$ 451</u>	<u>0,14</u>

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 113,000	21/07/2023	102	\$ (72)	\$ (114)	(0,04)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					<u>\$ 337</u>	<u>0,10</u>

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	\$ 179	0,05
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,500	15/06/2052	12 100	(4 116)	(1,27)
À recevoir ⁽¹⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250	20/09/2053	7 400	670	0,21
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2031	¥ 50 000	10	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,450	20/03/2029	154 390	36	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/12/2031	1 507 000	(64)	(0,02)
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,840	21/11/2028	\$ 3 100	296	0,09
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,888	21/11/2053	600	(170)	(0,05)
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,865	13/02/2054	10 900	241	0,07
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,085	13/02/2034	24 600	(442)	(0,14)
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,250	20/12/2025	35 500	213	0,07
À payer	EURIBOR EUR à 3 mois	0,526	21/11/2023	€ 1 500	(36)	(0,01)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,190	04/11/2052	200	92	0,03
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,195	04/11/2052	200	104	0,03
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,197	08/11/2052	400	183	0,06
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	600	(64)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	300	(31)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	300	(31)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	600	(56)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	200	(19)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,879	15/08/2032	8 400	(104)	(0,03)
À payer ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	19 500	139	0,04
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	39 400	(14)	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,359	15/08/2030	1 400	63	0,02
À recevoir	CPTFEMU	2,470	15/07/2032	1 100	53	0,02
À payer	CPTFEMU	2,590	15/12/2052	500	(28)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	2,600	15/05/2032	2 400	112	0,03
À payer	CPTFEMU	2,680	15/04/2053	2 100	(31)	(0,01)
À payer	CPTFEMU	2,700	15/04/2053	600	(8)	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,720	15/06/2032	4 200	104	0,03
À recevoir	CPTFEMU	2,965	15/05/2027	10 700	407	0,12
À recevoir	CPTFEMU	2,980	15/06/2027	9 900	208	0,06
À recevoir	CPTFEMU	3,000	15/05/2027	1 900	68	0,02
À recevoir	CPTFEMU	3,130	15/05/2027	2 100	61	0,02
À payer	CPURNSA	1,280	19/05/2030	\$ 600	(39)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	1,794	24/08/2027	850	59	0,02
À recevoir	CPURNSA	1,798	25/08/2027	300	21	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	CPURNSA	1,890 %	27/08/2027	\$ 500	\$ 35	0,01
À payer	CPURNSA	1,954	03/06/2029	750	(56)	(0,02)
À payer	CPURNSA	2,165	16/04/2029	500	(39)	(0,01)
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	(37)	(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	(45)	(0,01)
À payer	FRCPXTOB	1,590	15/02/2028	180	(30)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,480	15/01/2030	£ 800	(201)	(0,06)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,566	15/03/2036	500	(111)	(0,03)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,850	15/09/2024	400	(94)	(0,03)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,143	15/10/2032	400	19	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,288	15/02/2032	2 500	280	0,09
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,595	15/08/2032	4 600	15	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,615	15/02/2027	4 900	350	0,11
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,735	15/12/2026	400	54	0,02
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,200	15/06/2024	1 300	85	0,03
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,330	15/06/2024	1 800	111	0,03
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,600	15/05/2024	800	49	0,01
					\$ (1 467)	(0,45)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (1 467)	(0,45)

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,237 %	17/11/2023	2 300	\$ 143	\$ 505	0,16

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)	\$ (17)	(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	3,750 %	12/09/2023	16 200	\$ (46)	\$ (19)	(0,01)
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,340	17/11/2023	11 200	(141)	(826)	(0,26)
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,420	21/09/2023	38 400	(218)	(164)	(0,04)
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	12/09/2023	22 700	(64)	(26)	(0,01)
							\$ (469)	\$ (1 035)	(0,32)

(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)	\$ 5	\$ (1)	0,00
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	800	(26)	23	(3)	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	200	0	(2)	(2)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	400	(12)	10	(2)	0,00
					\$ (44)	\$ 36	\$ (8)	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.

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset 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.

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
MYC	À recevoir	CPURNSA	1,800 %	20/07/2026	\$ 600	\$ 0	\$ (88)	\$ (88)	(0,03)
	À recevoir	CPURNSA	1,805	20/09/2026	50	0	(7)	(7)	0,00
	À recevoir	CPURNSA	1,810	19/07/2026	500	0	(72)	(72)	(0,02)
						\$ 0	\$ (167)	\$ (167)	(0,05)

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notional	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/(moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	À recevoir	Indice TRNGLU Index	2 052	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	\$ 9 053	12/07/2023	\$ 0	\$ 243	\$ 243	0,07
	À recevoir	Indice TRNGLU Index	1 133	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	4 962	29/11/2023	0	166	166	0,05
	À recevoir	Indice BCOMTR Index	35 886	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	8 282	15/02/2024	0	(163)	(163)	(0,05)
JPM	À recevoir	Indice JMABDEWU Index	16 708	0,053 %	2 676	15/02/2024	0	18	18	0,01
	À recevoir	Indice JMABNIU5 Index	95 050	0,000	16 992	15/02/2024	0	(96)	(96)	(0,03)
MAC	À recevoir	Indice PIMCODBU Index	265 147	0,160	41 379	15/09/2023	0	(421)	(421)	(0,13)
SOG	À recevoir	Indice TRNGLU Index	656	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	2 899	07/02/2024	0	73	73	0,02
							\$ 0	\$ (180)	\$ (180)	(0,06)

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	
AZD	07/2023	\$ 403	AUD 608	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00	
	08/2023	AUD 608	\$ 404	0	(1)	(1)	0,00	
BOA	07/2023	¥ 2 493 300	17 926	676	0	676	0,21	
	07/2023	PLN 711	167	0	(8)	(8)	0,00	
	07/2023	SEK 4 917	455	0	0	0	0,00	
	07/2023	\$ 6 866	MXN 126 399	486	0	486	0,15	
	08/2023	CNY 1 684	\$ 238	5	0	5	0,00	
	08/2023	\$ 1 545	CNY 10 601	0	(78)	(78)	(0,02)	
	08/2023	290	SEK 3 128	0	0	0	0,00	
	09/2023	IDR 160 823	\$ 11	0	0	0	0,00	
	09/2023	\$ 1 038	KRW 1 315 383	0	(36)	(36)	(0,01)	
	BPS	07/2023	AUD 3 186	\$ 2 080	0	(41)	(41)	(0,01)
		07/2023	BRL 942	189	0	(6)	(6)	0,00
		07/2023	CHF 216	242	0	0	0	0,00
		07/2023	DKK 67 210	9 683	0	(165)	(165)	(0,05)
		07/2023	€ 998	1 088	0	(1)	(1)	0,00
07/2023		TRY 5 005	193	2	0	2	0,00	
07/2023		\$ 288	AUD 435	1	0	1	0,00	
07/2023		19	CHF 17	0	0	0	0,00	
07/2023		1 220	CZK 26 248	0	(16)	(16)	(0,01)	
07/2023		363	€ 333	0	0	0	0,00	
08/2023		AUD 435	\$ 288	0	(1)	(1)	0,00	
08/2023		\$ 242	CHF 216	0	0	0	0,00	
08/2023		1 823	CNY 12 467	0	(99)	(99)	(0,03)	
08/2023		64	ZAR 1 170	0	(2)	(2)	0,00	
09/2023	THB 6	\$ 0	0	0	0	0,00		
BRC	10/2023	\$ 457	ZAR 8 507	0	(12)	(12)	0,00	
	07/2023	MYR 1 065	\$ 227	0	(2)	(2)	0,00	
	07/2023	PHP 10 498	186	0	(4)	(4)	0,00	
	07/2023	\$ 1 926	MYR 8 837	0	(29)	(29)	(0,01)	
	08/2023	HUF 63 157	\$ 184	1	0	1	0,00	
	08/2023	\$ 365	COP 1 554 877	3	0	3	0,00	
	08/2023	16	ZAR 298	0	0	0	0,00	
	09/2023	MXN 9 026	\$ 517	0	(2)	(2)	0,00	
CBK	09/2023	\$ 730	HKD 5 700	0	(1)	(1)	0,00	
	07/2023	€ 37 165	\$ 39 883	0	(664)	(664)	(0,20)	
	07/2023	£ 133	169	0	0	0	0,00	
	07/2023	\$ 450	CLP 363 973	4	0	4	0,00	
	07/2023	1 075	CZK 23 164	0	(12)	(12)	0,00	
	07/2023	316	€ 291	2	0	2	0,00	
	07/2023	1 080	PHP 58 897	0	(15)	(15)	0,00	
	07/2023	1 025	RON 4 632	0	(6)	(6)	0,00	
	08/2023	CLP 864 597	\$ 1 044	0	(30)	(30)	(0,01)	
	08/2023	\$ 1 465	CLP 1 199 044	19	0	19	0,01	
09/2023	KRW 12 894	\$ 10	0	0	0	0,00		
CLY	07/2023	SGD 43	32	0	0	0	0,00	
DUB	07/2023	\$ 2 556	BRL 13 847	315	0	315	0,10	

Contrepartie	Mois de 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	07/2023	\$	CLP	558	\$ 0	\$ 0	0,00	
GLM	07/2023	BRL	\$	2 681	0	(2)	0,00	
	07/2023	\$	DKK	2 525	6	0	0,00	
	09/2023		BRL	13 089	2	0	0,00	
	10/2023		ZAR	5 096	0	(5)	0,00	
JPM	07/2023	MXN	\$	224	0	(5)	0,00	
	07/2023	\$	DKK	3 260	2	(1)	0,00	
	07/2023		£	16 551	115	0	0,04	
	07/2023		¥	868 528	0	(64)	(0,02)	
	07/2023		PHP	3 854	0	(1)	0,00	
	08/2023	£	\$	20 932	0	(115)	(0,04)	
	08/2023	¥		6 073	64	0	0,02	
	08/2023	TWD		232	4	0	0,00	
	08/2023	\$	CNY	13 152	0	(103)	(0,03)	
	08/2023		HUF	541 881	0	(7)	0,00	
	09/2023	IDR	\$	4	0	0	0,00	
	09/2023	SGD		284	0	0	0,00	
	09/2023	\$	IDR	30 134 290	0	(22)	(0,01)	
	09/2023		INR	189 607	4	0	0,00	
	09/2023		PEN	1 641	4	0	0,00	
	09/2023		THB	34 330	0	(26)	(0,01)	
	10/2023	MXN	\$	250	0	(1)	0,00	
MBC	07/2023	AUD		295	0	(3)	0,00	
	07/2023	CAD		1 269	0	(29)	(0,01)	
	07/2023	\$	€	151	0	(1)	0,00	
	08/2023		TWD	128 404	0	(90)	(0,03)	
	09/2023		KRW	2 438 339	0	(54)	(0,02)	
MYI	07/2023	£	\$	353	0	(9)	0,00	
	07/2023	IDR		3	0	0	0,00	
	07/2023	TRY		194	11	0	0,00	
	07/2023	\$	€	790	1	0	0,00	
	07/2023		IDR	42 403	0	0	0,00	
	07/2023		MYR	2 803	0	(7)	0,00	
	07/2023		SEK	4 913	0	(3)	0,00	
	08/2023		ZAR	4 017	5	0	0,00	
	09/2023	IDR	\$	3	0	0	0,00	
	09/2023	\$	ILS	3 076	0	(26)	(0,01)	
	09/2023		INR	40 954	1	0	0,00	
	09/2023		KRW	2 740 298	0	(53)	(0,02)	
	09/2023		THB	15 648	0	(12)	0,00	
RBC	07/2023	MXN	\$	530	0	(64)	(0,02)	
	08/2023			649	0	(1)	0,00	
RYL	07/2023	\$	PLN	14 293	143	0	0,04	
SCX	07/2023	CZK	\$	173	0	(2)	0,00	
	07/2023	\$	AUD	893	2	0	0,00	
	08/2023	AUD	\$	593	0	(2)	0,00	
	08/2023	TWD		212	4	0	0,00	
	09/2023			270	8	0	0,00	
	09/2023	\$	INR	118 584	2	0	0,00	
	09/2023		THB	35 526	0	(19)	(0,01)	
SOG	07/2023	SGD	\$	270	2	0	0,00	
SSB	07/2023	CLP		454	0	0	0,00	
	08/2023	\$	CLP	366 108	0	0	0,00	
	09/2023	BRL	\$	205	0	(8)	0,00	
TOR	07/2023	¥		409	14	0	0,00	
	07/2023	\$	AUD	1 099	6	0	0,00	
	07/2023		CAD	1 717	1	(1)	0,00	
	08/2023	AUD	\$	726	0	(6)	0,00	
	08/2023	CAD		1 298	1	(1)	0,00	
UAG	07/2023	£		20 104	0	(407)	(0,13)	
	07/2023	\$	AUD	599	2	0	0,00	
	07/2023		CHF	210	1	0	0,00	
	07/2023		SGD	6 557	0	(118)	(0,04)	
	07/2023		TRY	54 909	0	(292)	(0,09)	
	08/2023	AUD	\$	396	0	(2)	0,00	
					\$ 1 920	\$ (2 793)	\$ (873)	(0,27)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD	\$	12	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$	AUD	36	1	0	0,00
	08/2023			19	0	0	0,00
BOA	07/2023	KRW	\$	0	0	0	0,00
	07/2023	\$	AUD	111	2	0	0,00
BPS	07/2023	AUD	\$	68	0	0	0,00
	07/2023	\$	AUD	58	1	0	0,00

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
BRC	07/2023	\$	64 AUD	97	\$ 0	\$ 0	0,00
	08/2023		0 KRW	160	0	0	0,00
CBK	07/2023	KRW	160 \$	0	0	0	0,00
	08/2023		15 AUD	23	0	0	0,00
SCX	07/2023	AUD	33 \$	22	0	0	0,00
	08/2023		18 AUD	28	0	0	0,00
UAG	07/2023		22 \$	33	0	0	0,00
	08/2023	AUD	101 \$	67	0	0	0,00
			67 AUD	101	0	0	0,00
				\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€	938 \$	1 022	\$ 1	\$ (3)	0,00
	07/2023		17 264 €	16 064	262	0	0,08
BPS	07/2023	€	51 685 \$	56 628	240	(1)	0,07
	07/2023		56 373 €	52 440	840	0	0,27
CBK	08/2023		54 645 \$	49 803	0	(237)	(0,07)
	07/2023	€	16 413 \$	17 803	1	(105)	(0,03)
JPM	08/2023		13 294 €	12 211	46	0	0,01
	07/2023	€	49 469 \$	54 016	44	0	0,01
MBC	08/2023		54 091 €	49 469	0	(46)	(0,01)
	07/2023	€	2 928 \$	3 146	1	(49)	(0,02)
SOG	07/2023	\$	56 411 €	52 440	801	0	0,25
				\$ 2 236	\$ (441)	\$ 1 795	0,56

Au 30 juin 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	07/2023	£	385 \$	489	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	KRW	10	0	0	0	0,00
BPS	07/2023		7 \$	6	0	0	0,00
	07/2023		533	431	15	0	0,00
BRC	07/2023		11	9	0	0	0,00
	07/2023		2 KRW	3 074	0	0	0,00
CBK	08/2023	KRW	3 070 \$	2	0	0	0,00
	07/2023	£	20	25	0	0	0,00
JPM	07/2023		1 262	1 596	0	(9)	0,00
	08/2023		1 596 \$	1 262	9	0	0,00
MBC	07/2023	£	63	78	0	(2)	0,00
	07/2023		1 762 \$	1 423	47	0	0,02
MYI	07/2023		1 790	1 440	41	0	0,01
	07/2023		6	5	0	0	0,00
TOR	07/2023	£	1 265	1 608	0	(1)	0,00
	08/2023		1 608 \$	1 265	1	0	0,00
UAG	07/2023	KRW	3 058	2	0	0	0,00
				\$ 113	\$ (12)	\$ 101	0,03

Au 30 juin 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
BPS	07/2023	\$	8	11	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023		654	885	0	0	0,00
GLM	07/2023	SGD	117	87	1	0	0,00
	07/2023		2 151	1 590	0	0	0,00
JPM	08/2023		1 590 \$	2 149	0	0	0,00
	07/2023		1 492	2 016	0	(3)	0,00
MBC	07/2023	SGD	2 133	1 579	2	0	0,00
	08/2023		1 544 \$	2 085	0	(2)	0,00
UAG	07/2023	SGD	99	74	1	0	0,00
	07/2023		1 629 \$	2 204	0	(1)	0,00
				\$ 4	\$ (6)	\$ (2)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 123 0,04

Total des Investissements

\$ 360 568 111,23

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (36 390) (11,23)

Actifs nets

\$ 324 178 100,00

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) 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) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 5 441 \$ (31 décembre 2022 : 5 919 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 3 060 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 18 002	\$ 275 841	\$ 63	\$ 293 906
Fonds d'investissement	63 568	0	0	63 568
Contrats de mise en pension	0	4 101	0	4 101
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	360	(1 367)	0	(1 007)
Totaux	\$ 81 930	\$ 278 575	\$ 63	\$ 360 568

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 0	\$ 1	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BOA	1 307	(1 360)	(53)	441	(240)	201
BPS	745	(690)	55	(230)	620	390
BRC	(34)	20	(14)	170	170	340
CBK	(760)	760	0	430	(240)	190
DUB	(6)	0	(6)	(119)	0	(119)
FAR	(164)	0	(164)	S/O	S/O	S/O
GLM	(15)	0	(15)	557	(550)	7
GST	(1)	0	(1)	(118)	260	142
JPM	(258)	440	182	40	400	440
MAC	(421)	890	469	192	0	192
MBC	(183)	0	(183)	375	(200)	175
MYC	(170)	260	90	(176)	260	84
MYI	(51)	0	(51)	(336)	550	214
RBC	(65)	0	(65)	(21)	0	(21)
RYL	143	0	143	S/O	S/O	S/O
SAL	(2)	0	(2)	(2)	0	(2)
SCX	(7)	0	(7)	2 207	(260)	1 947
SOG	876	(650)	226	66	0	66
SSB	(8)	0	(8)	S/O	S/O	S/O
TOR	14	0	14	1	0	1
UAG	(818)	690	(128)	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	69,28	53,86
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	21,11	24,35
Autres valeurs mobilières	0,27	1,21
Fonds d'investissement	19,61	17,11
Contrats de mise en pension	1,27	10,10
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,10	0,49
Instruments financiers dérivés compensés	(0,45)	(0,47)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,04	0,98

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	2,65	3,02
Agences du gouvernement américain	17,58	10,47
Obligations du Trésor américain	28,19	29,26
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	4,19	4,06
Titres adossés à des actifs	3,51	3,00
Émissions souveraines	27,67	20,01
Actions ordinaires	0,23	0,37
Titres privilégiés	0,04	0,14
Sociétés d'investissement immobilier	5,32	1,75
Instruments à court terme	1,28	7,34
Fonds d'investissement	19,61	17,11
Contrats de mise en pension	1,27	10,10
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,14	0,49
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,04)	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	(0,45)	(0,47)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,16	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	(0,32)	(0,23)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,05)	(0,04)
Swaps de rendement total sur indices	(0,06)	(0,20)
Contrats de change à terme	(0,27)	0,33
Contrats de change à terme couverts	0,59	0,99
Autres actifs et passifs à court terme	(11,23)	(7,63)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES											
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS											
BANQUE ET FINANCE											
American Honda Finance Corp. 5,000 % éch. 23/05/2025	\$ 2 400	\$ 2 391	0,27	Société Générale S.A. 2,625 % éch. 22/01/2025	\$ 2 500	\$ 2 350	0,27	4,950 % éch. 08/06/2025	\$ 2 500	\$ 2 425	0,27
Banque de développement asiatique 6,550 % éch. 24/03/2026	ZAR 46 000	2 333	0,26	Standard Chartered PLC 1,822 % éch. 23/11/2025	2 600	2 432	0,27	Total des Obligations et billets privés		23 402	2,64
Banco de Sabadell S.A. 2,625 % éch. 24/03/2026	€ 3 500	3 633	0,41	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,464 % éch. 13/01/2026	3 300	3 291	0,37			218 430	24,65
Bank of Nova Scotia 5,450 % éch. 12/06/2025	\$ 1 800	1 791	0,20	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % éch. 06/04/2026	€ 2 000	2 155	0,24	AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Barclays PLC 5,304 % éch. 09/08/2026	3 500	3 416	0,39	Swedbank AB 3,356 % éch. 04/04/2025	\$ 4 000	3 828	0,43	Fannie Mae			
7,325 % éch. 02/11/2026	1 400	1 432	0,16	Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026	€ 6 700	7 300	0,82	0,000 % éch. 25/04/2040 (a)(b)	120	90	0,01
BNP Paribas S.A. 4,705 % éch. 10/01/2025	2 300	2 280	0,26	UBS Group AG 2,193 % éch. 05/06/2026	\$ 2 400	2 202	0,25	1,000 % éch. 25/01/2043	40	33	0,00
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % éch. 31/03/2027	€ 3 400	3 643	0,41	4,125 % éch. 24/09/2025	800	765	0,09	3,732 % éch. 01/01/2035	3	3	0,00
Capital One Financial Corp. 4,166 % éch. 09/05/2025	\$ 4 000	3 898	0,44	4,703 % éch. 05/08/2027	1 600	1 530	0,17	3,867 % éch. 01/12/2034	12	13	0,00
4,985 % éch. 24/07/2026	3 800	3 685	0,42	UniCredit SpA 7,830 % éch. 04/12/2023	6 350	6 388	0,72	3,872 % éch. 01/12/2034	3	3	0,00
Citigroup, Inc. 5,746 % éch. 25/01/2026 (d)	2 900	2 889	0,33	Wells Fargo & Co. 2,125 % éch. 20/12/2023	€ 900	1 122	0,13	3,952 % éch. 01/07/2035	2	2	0,00
Corsair International Ltd. 7,772 % éch. 28/01/2027	€ 2 600	2 822	0,32	3,908 % éch. 25/04/2026	\$ 2 700	2 612	0,29	4,036 % éch. 01/08/2035	15	15	0,00
Coventry Building Society 2,625 % éch. 07/12/2026	200	210	0,02	4,808 % éch. 25/07/2028	4 000	3 913	0,44	4,345 % éch. 01/05/2038	549	557	0,06
CPI Property Group S.A. 2,750 % éch. 12/05/2026	2 200	1 954	0,22	INDUSTRIE				4,550 % éch. 01/03/2035	1	1	0,00
Credit Suisse AG 3,700 % éch. 21/02/2025	\$ 4 000	3 825	0,43	Amgen, Inc. 5,150 % éch. 02/03/2028	500	500	0,06	4,943 % éch. 01/06/2043	19	19	0,00
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025	€ 1 200	1 282	0,14	5,250 % éch. 02/03/2025	2 600	2 588	0,29	4,944 % éch. 01/07/2042	18	17	0,00
Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % éch. 19/11/2025	1 975	1 860	0,21	Boeing Co. 1,950 % éch. 01/02/2024	3 500	3 421	0,39	4,994 % éch. 01/09/2041	44	43	0,01
CTP NV 0,500 % éch. 21/06/2025	2 300	2 237	0,25	CommonSpirit Health 1,547 % éch. 01/10/2025	2 900	2 639	0,30	5,036 % éch. 25/07/2037	17	16	0,00
Danske Bank A/S 3,773 % éch. 28/03/2025	\$ 4 000	3 911	0,44	Continental Resources, Inc. 2,268 % éch. 15/11/2026	2 900	2 583	0,29	5,500 % éch. 25/12/2036 - 25/03/2044	1 416	1 389	0,16
Deutsche Bank AG 3,961 % éch. 26/11/2025	4 000	3 816	0,43	CRH America, Inc. 3,875 % éch. 18/05/2025	2 700	2 601	0,29	5,560 % éch. 25/09/2035	119	117	0,01
6,119 % éch. 14/07/2026	4 000	3 957	0,45	Daimler Truck Finance North America LLC 5,691 % éch. 14/12/2023	3 000	3 001	0,34	5,650 % éch. 01/01/2035	4	4	0,00
6,309 % éch. 16/11/2027	1 500	1 382	0,16	5,841 % éch. 13/12/2024	2 800	2 797	0,31	0,650 % éch. 22/10/2025	23 500	21 295	2,40
Equinix, Inc. 2,625 % éch. 18/11/2024	3 400	3 248	0,37	Expedia Group, Inc. 5,000 % éch. 15/02/2026	3 393	3 347	0,38	0,680 % éch. 06/08/2025	11 300	10 321	1,17
GA Global Funding Trust 1,250 % éch. 08/12/2023	3 400	3 321	0,38	Hyundai Capital America 1,000 % éch. 17/09/2024	3 000	2 823	0,32	0,800 % éch. 28/10/2026	7 000	6 173	0,70
3,850 % éch. 11/04/2025	3 500	3 335	0,38	Nissan Motor Co. Ltd. 3,043 % éch. 15/09/2023	3 600	3 575	0,40	2,000 % éch. 15/11/2026	665	651	0,07
HSBC USA, Inc. 5,625 % éch. 17/03/2025	800	797	0,09	Penske Truck Leasing Co. LP 1,700 % éch. 15/06/2026	3 300	2 916	0,33	2,920 % éch. 25/01/2026	1 000	957	0,11
ING Groep NV 3,869 % éch. 28/03/2026	4 000	3 844	0,43	Reliance Steel & Aluminum Co. 1,300 % éch. 15/08/2025	3 900	3 562	0,40	3,590 % éch. 25/01/2025	3 592	3 496	0,39
Manulife Financial Corp. 4,150 % éch. 04/03/2026	1 500	1 453	0,16	Renesas Electronics Corp. 2,170 % éch. 25/11/2026	2 800	2 465	0,28	4,000 % éch. 01/12/2034	3	3	0,00
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,541 % éch. 17/04/2026	1 900	1 889	0,21	SK Hynix, Inc. 1,000 % éch. 19/01/2024	2 900	2 819	0,32	4,021 % éch. 01/09/2035	52	52	0,01
Mizuho Financial Group, Inc. 5,079 % éch. 19/07/2023	AUD 4 800	3 195	0,36	TD SYNEX Corp. 1,250 % éch. 09/08/2024	4 300	4 069	0,46	4,150 % éch. 01/01/2035	8	8	0,00
6,201 % éch. 10/07/2024	\$ 3 100	3 100	0,35	VMware, Inc. 1,000 % éch. 15/08/2024	2 700	2 557	0,29	5,176 % éch. 25/02/2045	62	60	0,01
Morgan Stanley 6,138 % éch. 16/10/2026	2 700	2 728	0,31	WRKCo, Inc. 3,750 % éch. 15/03/2025	2 700	2 599	0,29	5,323 % éch. 01/07/2035	8	8	0,00
National Bank of Canada 3,500 % éch. 25/04/2028	€ 2 000	2 171	0,25					5,513 % éch. 15/02/2037	17	17	0,00
NatWest Group PLC 7,472 % éch. 10/11/2026	\$ 1 300	1 330	0,15					5,523 % éch. 25/09/2024	794	791	0,09
NatWest Markets PLC 3,479 % éch. 22/03/2025	4 000	3 838	0,43					5,643 % éch. 15/09/2041	4	4	0,00
Pricoa Global Funding 4,200 % éch. 28/08/2025	2 700	2 619	0,30					5,683 % éch. 25/07/2026	319	318	0,04
Santander Holdings USA, Inc. 3,450 % éch. 02/06/2025	2 700	2 547	0,29					5,693 % éch. 25/10/2026	293	292	0,03
Santander UK Group Holdings PLC 6,833 % éch. 21/11/2026	2 300	2 306	0,26					6,500 % éch. 25/07/2043	76	78	0,01
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC 7,230 % éch. 17/03/2026	4 000	3 910	0,44					Ginnie Mae			
								3,000 % éch. 20/06/2027	9	9	0,00
								3,575 % éch. 20/07/2067	5 315	5 316	0,60
								4,643 % éch. 20/10/2065	2 494	2 523	0,29
								5,318 % éch. 20/06/2065	11	11	0,00
								5,545 % éch. 20/04/2066	919	914	0,10
								5,816 % éch. 20/10/2072	1 941	1 926	0,22
								5,866 % éch. 20/04/2072	1 939	1 928	0,22
								5,894 % éch. 20/05/2066	1 500	1 465	0,17
								5,966 % éch. 20/01/2073	1 159	1 149	0,13
								6,066 % éch. 20/05/2073	817	814	0,09
								6,144 % éch. 20/02/2062	2 003	2 006	0,23
								6,166 % éch. 20/05/2073	14	14	0,00
								6,177 % éch. 20/08/2071	4 325	4 329	0,49
								6,226 % éch. 20/11/2072	988	999	0,11
								6,236 % éch. 20/11/2072	8 250	8 335	0,94
								6,236 % éch. 20/11/2072	9 527	9 633	1,09
								Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			
								3,000 % éch. 01/02/2052	17 930	15 812	1,78
								3,500 % éch. 01/07/2047	29 816	27 555	3,11
								4,000 % éch. 01/10/2047	20	19	0,00
								5,000 % éch. 01/02/2025 - 01/10/2031	561	557	0,06
								6,000 % éch. 01/12/2023 - 01/01/2041	903	937	0,11
								6,500 % éch. 01/12/2035 - 01/01/2036	9	9	0,00
								Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
								4,000 % éch. 01/08/2053	19 600	18 411	2,08
								4,500 % éch. 01/08/2053	42 600	40 979	4,63
								5,000 % éch. 01/08/2053	60 800	59 589	6,73
								5,500 % éch. 01/08/2053	6 300	6 269	0,71
										258 494	29,18
								OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
								Billets du Trésor américain			
								0,250 % éch. 31/05/2025	27 900	25 537	2,88
								0,375 % éch. 31/01/2026 (e)	139 800	125 544	14,16

Tableau des investissements Fonds Low Average Duration 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
0,875 % éch. 31/01/2024	\$ 53 300	\$ 51 925	5,86	Sequoia Mortgage Trust				Gallatin CLO Ltd.			
2,875 % éch. 15/05/2032 (e)	1 800	1 670	0,19	5,577 % éch. 20/06/2036	\$ 218	\$ 203	0,02	6,311 % éch. 21/01/2028	\$ 940	\$ 939	0,11
4,125 % éch. 31/01/2025	38 500	37 902	4,28	5,957 % éch. 20/10/2027	1	1	0,00	GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC			
4,250 % éch. 31/12/2024 (e)	183 100	180 568	20,38	Stratton Mortgage Funding PLC				4,100 % éch. 20/01/2032	€ 2 500	2 660	0,30
4,250 % éch. 31/05/2025 (f)	19 800	19 552	2,21	5,391 % éch. 20/07/2060	€ 2 766	3 517	0,40	GoldenTree Loan Opportunities Ltd.			
4,375 % éch. 31/10/2024 (e)	88 200	87 151	9,83	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				6,370 % éch. 20/07/2031	\$ 2 650	2 630	0,30
		529 849	59,79	3,934 % éch. 25/01/2035	\$ 126	125	0,01	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.			
TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				Structured Asset Mortgage Investments Trust				6,373 % éch. 15/09/2037	\$ 1 352	1 334	0,15
Avon Finance PLC				5,646 % éch. 19/07/2035	14	13	0,00	Griffith Park CLO DAC			
5,809 % éch. 20/09/2048	£ 1 617	2 055	0,23	Thornburg Mortgage Securities Trust				4,103 % éch. 21/11/2031	€ 3 000	3 211	0,36
Banc of America Mortgage Trust				5,830 % éch. 25/04/2043	0	0	0,00	Harvest CLO DAC			
4,020 % éch. 25/08/2034	\$ 244	234	0,03	Towd Point Mortgage Funding PLC				4,250 % éch. 26/06/2030	2 659	2 842	0,32
5,268 % éch. 25/07/2034	11	10	0,00	5,635 % éch. 20/10/2051	£ 2 261	2 878	0,33	Jubilee CLO DAC			
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				5,841 % éch. 20/07/2045	2 527	3 214	0,36	3,787 % éch. 15/04/2030	4 000	4 277	0,48
3,907 % éch. 25/01/2034	6	6	0,00	6,097 % éch. 20/05/2045	4 978	6 311	0,71	Madison Park Euro Funding DAC			
4,752 % éch. 25/07/2034	117	106	0,01	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				3,927 % éch. 15/01/2032	2 700	2 884	0,33
4,963 % éch. 25/01/2035	6	5	0,00	5,376 % éch. 25/06/2042	\$ 4	4	0,00	Marble Point CLO Ltd.			
Bear Stearns ALT-A Trust				5,830 % éch. 25/01/2045	426	405	0,05	6,442 % éch. 18/12/2030	\$ 3 502	3 451	0,39
4,622 % éch. 25/12/2033	26	25	0,00	Warwick Finance Residential Mortgages PLC				Nassau Ltd.			
5,470 % éch. 25/02/2034	49	44	0,01	5,865 % éch. 21/12/2049	£ 929	1 175	0,13	6,410 % éch. 15/10/2029	1 273	1 271	0,14
Benchmark Mortgage Trust				Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust				OCP Euro CLO DAC			
3,965 % éch. 10/04/2051	966	919	0,10	3,995 % éch. 15/05/2047	\$ 4 300	4 188	0,47	4,713 % éch. 20/01/2033	€ 2 000	2 179	0,25
Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.						50 600	5,71	Octagon Loan Funding Ltd.			
7,000 % éch. 25/12/2018	1	1	0,00	TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				6,525 % éch. 18/11/2031	\$ 3 400	3 368	0,38
Citigroup Mortgage Loan Trust				Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through				Palmer Square European Loan Funding DAC			
5,410 % éch. 25/10/2035	14	13	0,00	Certificates				3,897 % éch. 15/10/2031	€ 2 533	2 709	0,31
Countrywide Alternative Loan Trust				6,170 % éch. 25/10/2034	951	938	0,11	3,907 % éch. 15/07/2031	2 188	2 332	0,26
6,000 % éch. 25/10/2033	9	9	0,00	Ares European CLO DAC				4,727 % éch. 15/11/2032	3 250	3 545	0,40
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				4,050 % éch. 20/04/2032	€ 3 100	3 319	0,37	Saranac CLO Ltd.			
3,810 % éch. 25/11/2034	31	28	0,00	Avoca CLO DAC				7,120 % éch. 22/06/2030	\$ 2 681	2 656	0,30
3,864 % éch. 20/02/2035	8	8	0,00	3,997 % éch. 15/10/2032	3 000	3 200	0,36	SLM Student Loan Trust			
DBGS Mortgage Trust				Barings Euro CLO DAC				5,405 % éch. 25/10/2029	370	369	0,04
6,038 % éch. 15/06/2033	2 800	2 608	0,30	4,302 % éch. 25/11/2029	997	1 082	0,12	Tikehau CLO DAC			
Eurosail PLC				Black Diamond CLO DAC				4,144 % éch. 04/08/2034	€ 2 300	2 452	0,28
5,940 % éch. 13/06/2045	£ 4 157	5 212	0,59	4,303 % éch. 15/05/2032	2 700	2 882	0,33	Toro European CLO DAC			
Formentera Issuer PLC				BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				3,995 % éch. 12/01/2032	2 500	2 675	0,30
5,357 % éch. 28/07/2047	2 467	3 112	0,35	4,073 % éch. 15/01/2031	2 386	2 551	0,29	4,133 % éch. 15/02/2034	3 200	3 398	0,38
Great Hall Mortgages PLC				BNPP AM Euro CLO DAC				Venture CLO Ltd.			
5,644 % éch. 18/06/2039	\$ 376	372	0,04	4,031 % éch. 22/07/2032	3 000	3 198	0,36	6,350 % éch. 20/01/2029	\$ 2 490	2 473	0,28
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				Bridgepoint CLO DAC						96 291	10,87
4,070 % éch. 25/09/2035	74	70	0,01	4,387 % éch. 15/01/2034	3 400	3 658	0,41	ACTIONS			
6,000 % éch. 25/03/2032	0	0	0,00	Cairn CLO DAC				FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
IndyMac Mortgage Loan Trust				4,212 % éch. 20/10/2028	118	129	0,01	PIMCO Funds: Global			
5,630 % éch. 25/04/2035	264	222	0,03	Carbone CLO Ltd.				Investors Series plc - Fonds			
Morgan Stanley Capital Trust				6,390 % éch. 20/01/2031	\$ 3 534	3 510	0,40	US Short-Term Fund (c)	3 280 181	32 933	3,72
6,093 % éch. 15/07/2035	4 260	4 211	0,48	Carlyle Euro CLO DAC				PIMCO Select Funds plc - Fonds			
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				3,877 % éch. 15/01/2031	€ 2 190	2 339	0,26	PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	307 203	3 059	0,34
4,552 % éch. 25/10/2034	283	266	0,03	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.						35 992	4,06
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				4,073 % éch. 15/11/2031	2 600	2 783	0,31	FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
5,790 % éch. 25/02/2035	60	56	0,01	Catamaran CLO Ltd.				PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO			
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through				6,373 % éch. 22/04/2030	\$ 3 087	3 069	0,35	US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)	484 660	48 141	5,44
Certificates				CBAM Ltd.				Total des Fonds d'investissement			
5,710 % éch. 25/12/2035	276	256	0,03	6,280 % éch. 17/04/2031	500	494	0,06			\$84 133	9,50
Prime Mortgage Trust				CIFC Funding Ltd.							
5,550 % éch. 25/02/2034	2	2	0,00	6,440 % éch. 16/11/2030	2 121	2 113	0,24				
Primrose Residential DAC				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust							
4,189 % éch. 24/03/2061	€ 2 857	3 096	0,35	6,200 % éch. 25/11/2034	418	413	0,05				
Ripon Mortgages PLC				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.							
5,491 % éch. 28/08/2056	£ 4 437	5 620	0,63	4,599 % éch. 25/01/2032	7	6	0,00				
				Fortress Investment Group LLC							
				6,917 % éch. 23/02/2039	7 200	6 952	0,78				

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 septembre	Court	09/2023	91	\$ 150	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	42	(152)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	1 073	(3 156)	(0,36)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	297	(591)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	779	1 556	0,18
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	544	411	0,05
				\$ (1 782)	(0,20)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (1 782)	(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 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	\$ 6	0,00

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

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel ⁽²⁾	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	(5,000) %	20/06/2027	\$ 10 094	\$ (298)	(0,04)
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	(1,000)	20/12/2027	9 700	(86)	(0,01)
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	(1,000)	20/06/2028	112 100	(816)	(0,09)
				\$ (1 200)	(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	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000 %	17/03/2024	¥ 5 680 000	\$ (71)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,380	18/06/2028	90 000	(9)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	\$ 3 930	141	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,340	23/02/2030	2 900	(72)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	1 100	(19)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	1 200	(17)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	1 800	(15)	0,00
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,270	13/09/2024	5 000	47	0,01
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,350	14/09/2024	3 200	28	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024	NZD 279 100	(2 375)	(0,27)
À payer ⁽⁴⁾	BBR NZD à 3 mois	4,500	13/09/2024	8 800	(66)	(0,01)
					\$ (2 428)	(0,27)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (3 622)	(0,41)

⁽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.

Tableau des investissements Fonds Low Average Duration 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

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	3,750 %	12/09/2023	12 600	\$ 101	\$ 184	0,02
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	11/09/2023	11 800	88	170	0,02
							\$ 189	\$ 354	0,04

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 de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,250 %	12/09/2023	12 600	\$ (63)	\$ (125)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,750	12/09/2023	12 600	(38)	(71)	(0,01)
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,233	11/09/2023	11 800	(55)	(119)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,715	11/09/2023	11 800	(33)	(70)	(0,01)
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	26 600	(193)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	26 600	(193)	(514)	(0,06)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	40 700	(148)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	40 700	(148)	(529)	(0,06)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	14 800	(46)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	14 800	(46)	(185)	(0,02)
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,715	11/09/2023	10 700	(30)	(64)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	53 500	(361)	(10)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	53 500	(361)	(1 127)	(0,13)
							\$ (1 715)	\$ (2 825)	(0,32)

⁽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
BOA	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000 %	20/12/2026	\$ 2 000	\$ (94)	\$ 23	\$ (71)	(0,01)
CBK	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	5 600	(270)	72	(198)	(0,02)
MYC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	1 900	(108)	50	(58)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	2 300	(205)	104	(101)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	4 200	(195)	47	(148)	(0,02)
					\$ (872)	\$ 296	\$ (576)	(0,07)

⁽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	07/2023	AUD	373	\$ 244	\$ 0	\$ (4)	0,00
	07/2023	\$	513	AUD 773	2	2	0,00
	08/2023	AUD	773	\$ 514	0	(2)	0,00
BOA	08/2023	¥	54 000	383	7	7	0,00
	08/2023	NZD	615	390	13	13	0,00
	08/2023	\$	588	€ 545	8	8	0,00
BPS	07/2023	1 357	AUD 2 016	2	(17)	(15)	0,00
	08/2023	AUD	553	\$ 366	0	(2)	0,00
	08/2023	\$	4	CNY 29	0	0	0,00
	08/2023	5 132	€ 4 767	80	0	80	0,01
	08/2023	179	ZAR 3 332	0	(3)	(3)	0,00
BRC	08/2023	£	1 157	\$ 1 452	0	(19)	0,00
	08/2023	\$	277	¥ 36 619	0	(22)	0,00
	08/2023	218	ZAR 4 032	0	(6)	(6)	0,00
	09/2023	20	ILS 71	0	(1)	(1)	0,00
CBK	08/2023	CNH	169	\$ 24	1	1	0,00
	08/2023	€	104	114	0	0	0,00
	08/2023	\$	101	PEN 393	8	8	0,00
DUB	07/2023	4 847	BRL 26 265	596	0	596	0,07
	10/2023	ZAR	78 208	\$ 4 295	198	198	0,02
GLM	07/2023	BRL	26 348	5 457	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
JPM	09/2023	\$ 5 457	BRL 26 640	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
	08/2023	£ 12 768	\$ 16 171	0	(65)	(65)	(0,01)
	08/2023	\$ 1 000	£ 808	27	0	27	0,00
	09/2023	PEN 1 470	\$ 399	0	(4)	(4)	0,00
MBC	09/2023	\$ 19	ILS 68	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	€ 89 562	\$ 98 830	915	0	915	0,10
	07/2023	\$ 1 299	€ 1 192	1	0	1	0,00
	07/2023	53	£ 42	0	0	0	0,00
MYI	08/2023	NZD 830	\$ 521	13	0	13	0,00
	08/2023	\$ 3 946	¥ 524 367	0	(294)	(294)	(0,03)
	08/2023	211	ZAR 4 086	5	0	5	0,00
	08/2023	£ 2 468	\$ 3 118	0	(20)	(20)	0,00
RBC	08/2023	MXN 1 115	64	0	0	0	0,00
	07/2023	AUD 1 650	1 078	0	(20)	(20)	0,00
	07/2023	\$ 754	AUD 1 136	2	0	2	0,00
	08/2023	AUD 1 136	\$ 755	0	(2)	(2)	0,00
SCX	08/2023	CNH 319	46	3	0	3	0,00
	08/2023	NZD 218	136	3	0	3	0,00
	07/2023	AUD 2 461	1 610	0	(28)	(28)	0,00
	07/2023	1 302	852	0	(15)	(15)	0,00
SOG	07/2023	\$ 923	AUD 1 398	7	0	7	0,00
	08/2023	AUD 1 398	\$ 924	0	(7)	(7)	0,00
	08/2023	NZD 526	328	6	0	6	0,00
	08/2023	\$ 1 821	¥ 241 503	0	(140)	(140)	(0,02)
TOR	07/2023	AUD 298	\$ 195	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$ 446	AUD 674	3	0	3	0,00
	08/2023	AUD 674	\$ 446	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023	£ 11 184	14 136	0	(86)	(86)	(0,01)
UAG	08/2023	\$ 2 161	ZAR 41 491	27	(1)	26	0,00
	09/2023	16	ILS 59	0	(1)	(1)	0,00
	10/2023	ZAR 25 203	\$ 1 361	41	0	41	0,01
				\$ 1 972	\$ (771)	\$ 1 201	0,14

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 310	\$ 338	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$ 19 673	€ 18 305	298	0	298	0,04
BPS	07/2023	€ 19 585	\$ 21 450	83	0	83	0,01
	07/2023	\$ 19 672	€ 18 300	293	0	293	0,03
CBK	08/2023	18 696	17 039	0	(81)	(81)	(0,01)
	07/2023	€ 18 165	\$ 19 759	4	(63)	(59)	(0,01)
CLY	07/2023	\$ 120	€ 112	2	0	2	0,00
	08/2023	18 135	16 657	63	0	63	0,01
JPM	07/2023	€ 2 917	\$ 3 123	0	(59)	(59)	(0,01)
	07/2023	16 657	18 188	15	0	15	0,00
MBC	08/2023	\$ 18 213	€ 16 657	0	(16)	(16)	0,00
	07/2023	€ 112	\$ 121	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07/2023	\$ 2 830	€ 2 646	57	0	57	0,01
	07/2023	19 686	18 300	279	0	279	0,03
				\$ 1 094	\$ (221)	\$ 873	0,10

Au 30 juin 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
BPS	07/2023	\$ 9 062	£ 7 327	\$ 253	\$ 0	\$ 253	0,03
BRC	07/2023	£ 15	\$ 19	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 17	£ 14	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	£ 99	\$ 126	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 179	£ 140	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07/2023	£ 7 287	\$ 9 213	0	(51)	(51)	(0,01)
	08/2023	\$ 9 215	£ 7 287	51	0	51	0,01
MBC	07/2023	9 070	7 327	245	0	245	0,03
MYI	07/2023	9 041	7 274	207	0	207	0,02
TOR	07/2023	£ 7 307	\$ 9 285	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023	\$ 9 287	£ 7 307	5	0	5	0,00
				\$ 761	\$ (57)	\$ 704	0,08

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (269) (0,03)

Tableau des investissements Fonds Low Average Duration 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. 01/08/2053	\$ 24 500	\$ (21 597)	(2,44)
3,500 % éch. 01/08/2053	31 000	(28 282)	(3,19)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (49 879)	(5,63)
Total des Investissements		\$ 1 182 245	133,43
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (296 233)	(33,43)
Actifs nets		\$ 886 012	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 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.	5,746 %	25/01/2026	18/01/2022	\$ 2 900	\$ 2 889	0,33

(e) Des titres d'une juste valeur globale de 221 382 \$ (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 30 juin 2023.

(f) Un titre d'une juste valeur globale de 19 552 \$ (31 décembre 2022 : 4 050 \$) 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 9 570 \$ (31 décembre 2022 : 16 925 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 2 031 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 1 153 092	\$ 572	\$ 1 153 664
Fonds d'investissement	84 133	0	0	84 133
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(2)	(5 671)	0	(5 673)
Titres vendus à découvert	0	(49 879)	0	(49 879)
Totaux	\$ 84 131	\$ 1 097 542	\$ 572	\$ 1 182 245

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 30 juin 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	5,180 %	14/06/2023	05/07/2023	\$ (26 570)	\$ (26 635)	(3,00)
	5,180	15/06/2023	13/07/2023	(139 826)	(140 148)	(15,82)
	5,180	20/06/2023	13/07/2023	(3 026)	(3 031)	(0,34)
GRE	5,180	22/06/2023	06/07/2023	(52 104)	(52 171)	(5,89)
Total des Contrats de prise en pension					\$ (221 985)	(25,05)

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 30 juin 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	4,900 %	28/06/2023	05/07/2023	\$ (19 666)	\$ (19 674)	(2,22)
Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos					\$ (19 674)	(2,22)

⁽¹⁾ Le montant à payer sur les opérations par vente et rachat dos-à-dos comprend 11 \$ de baisse de prix différée.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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)	\$ 10	\$ 6	\$ S/O	\$ S/O	\$ S/O
BOA	242	(340)	(98)	(1 233)	1 360	127
BPS	608	(690)	(82)	(2 779)	2 650	(129)
BRC	(48)	30	(18)	8	0	8
CBK	(184)	200	16	903	(890)	13
CLY	(59)	0	(59)	S/O	S/O	S/O
DUB	794	(660)	134	S/O	S/O	S/O
FAR	(19)	0	(19)	(22)	0	(22)
GLM	(1 240)	1 051	(189)	(802)	751	(51)
JPM	(44)	0	(44)	97	(190)	(93)
MBC	1 216	(1 310)	(94)	1 204	(980)	224
MYC	(1 508)	730	(778)	(1 239)	510	(729)
MYI	(68)	0	(68)	(103)	30	(73)
RBC	(20)	0	(20)	(1)	0	(1)
SAL	S/O	S/O	S/O	(4)	0	(4)
SCX	(14)	10	(4)	277	(230)	47
SOG	251	(290)	(39)	S/O	S/O	S/O
TOR	(149)	0	(149)	5	(10)	(5)
UAG	(23)	0	(23)	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	89,92	70,91
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	40,28	43,49
Autres valeurs mobilières	S/O	0,78
Fonds d'investissement	9,50	7,98
Contrats de mise en pension	S/O	0,09
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,20)	0,21
Instruments financiers dérivés compensés	(0,41)	(0,55)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,03)	(0,32)
Titres vendus à découvert	(5,63)	(7,17)
Contrats de prise en pension	(25,05)	(13,50)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	(2,22)	(0,38)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	24,65	28,04
Agences du gouvernement américain	29,18	22,99
Obligations du Trésor américain	59,79	47,28
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	5,71	6,37
Titres adossés à des actifs	10,87	9,23
Instruments à court terme	S/O	1,27
Fonds d'investissement	9,50	7,98
Contrats de mise en pension	S/O	0,09
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,20)	0,21

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
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	(0,14)	(0,07)
Swaps de taux d'intérêt	(0,27)	(0,48)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,04	0,03
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,32)	(0,19)
Options sur titres	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,07)	(0,07)
Contrats de change à terme	0,14	(0,27)
Contrats de change à terme couverts	0,18	0,18
Titres vendus à découvert	(5,63)	(7,17)
Autres actifs et passifs à court terme	(33,43)	(15,42)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET		
VALEURS MOBILIÈRES													
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS													
Delos Finance SARL	\$	420	\$	420	0,05			ING Belgium S.A.	€	2 300	\$	2 491	0,31
7,288 % éch. 06/10/2023								3,375 % éch. 31/05/2027					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS													
BANQUE ET FINANCE													
ABN AMRO Bank NV	€	700	755	0,09				ING Groep NV		2 000		2 169	0,27
3,625 % éch. 10/01/2026								1,000 % éch. 20/09/2023					
Aegon Bank NV		3 300	3 477	0,44				Intesa Sanpaolo SpA	\$	2 200		2 132	0,27
0,625 % éch. 21/06/2024								5,017 % éch. 26/06/2024		600		606	0,08
AerCap Ireland Capital DAC	\$	1 700	1 673	0,21				7,000 % éch. 21/11/2025					
1,150 % éch. 29/10/2023								Jackson National Life Global Funding		1 000		929	0,12
2,875 % éch. 14/08/2024		700	673	0,08				1,750 % éch. 12/01/2025					
Ally Financial, Inc.		500	493	0,06				John Deere Capital Corp.		1 000		999	0,13
1,450 % éch. 02/10/2023								5,202 % éch. 11/10/2024					
AMCO - Asset Management Co. SpA	€	1 400	1 518	0,19				JPMorgan Chase & Co.		1 600		1 594	0,20
4,625 % éch. 06/02/2027								5,690 % éch. 10/12/2025					
American Honda Finance Corp.	\$	1 800	1 793	0,22				KeyBank N.A.		250		246	0,03
5,000 % éch. 23/05/2025								5,432 % éch. 03/01/2024					
American Tower Corp.		4 000	3 523	0,44				Kilroy Realty LP		800		758	0,10
1,450 % éch. 15/09/2026		900	844	0,11				3,450 % éch. 15/12/2024					
3,650 % éch. 15/03/2027		1 000	989	0,12				LeasePlan Corp. NV	€	3 600		3 898	0,49
5,250 % éch. 15/07/2028								0,125 % éch. 13/09/2023		\$	1 500	1 430	0,18
Ares Capital Corp.		800	694	0,09				2,875 % éch. 24/10/2024					
2,875 % éch. 15/06/2027								Lloyds Banking Group PLC		2 000		1 996	0,25
Assurant, Inc.		250	248	0,03				4,050 % éch. 16/08/2023					
4,200 % éch. 27/09/2023								Logicor Financing SARL	€	400		416	0,05
Athene Global Funding		2 500	2 476	0,31				0,750 % éch. 15/07/2024		800		726	0,09
5,790 % éch. 24/05/2024								1,625 % éch. 15/07/2027		300		305	0,04
Aviation Capital Group LLC		800	787	0,10				2,250 % éch. 13/05/2025					
4,375 % éch. 30/01/2024		700	686	0,09				Lseg Netherlands BV		1 000		1 017	0,13
5,500 % éch. 15/12/2024								0,000 % éch. 06/04/2025 (c)					
Avolon Holdings Funding Ltd.		529	447	0,06				LSEGA Financing PLC	\$	1 600		1 428	0,18
2,528 % éch. 18/11/2027								1,375 % éch. 06/04/2026					
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	€	900	874	0,11				MassMutual Global Funding		1 900		1 886	0,24
1,875 % éch. 09/01/2026		500	512	0,06				0,480 % éch. 28/08/2023		1 000		978	0,12
2,625 % éch. 28/04/2025		4 100	4 347	0,54				4,500 % éch. 10/04/2026					
3,625 % éch. 24/09/2024								Metropolitan Life Global Funding	€	2 100		2 231	0,28
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	\$	1 400	1 386	0,17				0,375 % éch. 09/04/2024		\$	300	297	0,04
0,875 % éch. 18/09/2023								0,450 % éch. 01/09/2023					
Banco BTG Pactual S.A.		500	483	0,06				Mitsubishi HC Capital, Inc.		200		199	0,02
4,500 % éch. 10/01/2025								3,960 % éch. 19/09/2023		1 200		1 173	0,15
Banco de Sabadell S.A.	€	600	660	0,08				5,080 % éch. 15/09/2027					
5,125 % éch. 10/11/2028								Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	€	2 300		2 472	0,31
Banco Santander Chile	\$	500	479	0,06				3,273 % éch. 19/09/2025		\$	3 000	3 001	0,38
2,700 % éch. 10/01/2025								6,128 % éch. 26/07/2023					
Bank of America Corp.	€	10 200	10 951	1,37				Mizuho Financial Group, Inc.	€	400		433	0,05
2,375 % éch. 19/06/2024		2 300	2 266	0,28				1,020 % éch. 11/10/2023		€	2 100	2 542	0,32
5,080 % éch. 20/01/2027								5,628 % éch. 13/06/2028					
Bank of Ireland Group PLC		1 100	1 093	0,14				Morgan Stanley	€	2 100		2 305	0,29
6,253 % éch. 16/09/2026								4,656 % éch. 02/03/2029		\$	455	454	0,06
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT		700	700	0,09				5,686 % éch. 24/01/2025					
4,625 % éch. 20/07/2023								Morgan Stanley Bank N.A.		3 000		2 957	0,37
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.	€	3 000	3 658	0,46				4,754 % éch. 21/04/2026					
4,875 % éch. 25/09/2025								Nasdaq, Inc.		500		502	0,06
Barclays PLC	€	400	431	0,05				5,650 % éch. 28/06/2025					
3,375 % éch. 02/04/2025								National Bank of Canada		1 500		1 497	0,19
BGC Partners, Inc.	\$	400	387	0,05				5,579 % éch. 06/08/2024					
8,000 % éch. 25/05/2028								Nationwide Mutual Insurance Co.		450		450	0,06
Blackstone Private Credit Fund		900	841	0,11				7,842 % éch. 15/12/2024					
2,350 % éch. 22/11/2024		700	675	0,08				NatWest Group PLC		2 000		1 979	0,25
4,700 % éch. 24/03/2025								5,847 % éch. 02/03/2027		1 200		1 228	0,15
BNP Paribas S.A.		1 500	1 388	0,17				7,472 % éch. 10/11/2026					
2,219 % éch. 09/06/2026		500	494	0,06				NatWest Markets PLC	€	1 300		1 379	0,17
3,800 % éch. 10/01/2024								1,000 % éch. 28/05/2024					
BPCE S.A.		1 075	1 004	0,13				Nissan Motor Acceptance Co. LLC	\$	1 400		1 305	0,16
1,625 % éch. 14/01/2025		300	269	0,03				1,125 % éch. 16/09/2024		1 000		995	0,12
1,652 % éch. 06/10/2026		600	644	0,08				3,875 % éch. 21/09/2023					
3,625 % éch. 17/04/2026	€	300	644	0,08				Nomura Holdings, Inc.		500		458	0,06
5,700 % éch. 22/10/2023	\$	800	797	0,10				1,851 % éch. 16/07/2025		2 800		2 652	0,33
5,975 % éch. 18/01/2027		2 800	2 775	0,35				2,648 % éch. 16/01/2025		2 800		2 749	0,34
Canadian Imperial Bank of Commerce		700	699	0,09				5,386 % éch. 06/07/2027					
5,490 % éch. 14/12/2023								NongHyup Bank		2 500		2 370	0,30
								0,875 % éch. 28/07/2024					
								Nordea Bank Abp	€	900		886	0,11
								1,125 % éch. 16/02/2027					
								Nova Kreditna Banka Maribor d.d.		600		633	0,08
								1,875 % éch. 27/01/2025					
								NTT Finance Corp.	\$	1 200		1 160	0,15
								0,583 % éch. 01/03/2024					

Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	%	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	%	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	%			
Ipalco Enterprises, Inc. 3,700 % éch. 01/09/2024	\$ 1 348	\$ 1 304	0,16		Titre adossé à des créances hypothécaires uniformes (UMBS), TBA	\$ 8 900	\$ 8 120	1,02		Becton Dickinson and Co. 5,390 % éch. 10/07/2023	\$ 700	\$ 699	0,09				
ITC Holdings Corp. 4,950 % éch. 22/09/2027	850	837	0,11		3,500 % éch. 01/08/2053	27 100	25 456	3,19		Constellation Brands, Inc. 5,580 % éch. 17/07/2023	250	249	0,03				
Jersey Central Power & Light Co. 4,700 % éch. 01/04/2024	1 083	1 072	0,13		4,500 % éch. 01/07/2053	5 200	5 000	0,63		5,580 % éch. 18/07/2023	850	848	0,11				
KeySpan Gas East Corp. 2,742 % éch. 15/08/2026	1 600	1 454	0,18		5,000 % éch. 01/09/2053	4 300	4 216	0,53		5,610 % éch. 11/07/2023	300	299	0,04				
Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % éch. 18/09/2027	€ 600	599	0,08		OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN						Crown Castle, Inc. 5,870 % éch. 20/07/2023	600	598	0,08			
Midwest Connector Capital Co. LLC 3,900 % éch. 01/04/2024	\$ 200	196	0,02		Billets du Trésor américain						Dominion Resources, Inc. 5,400 % éch. 19/07/2023	300	299	0,04			
Mississippi Power Co. 3,950 % éch. 30/03/2028	2 495	2 349	0,29		1,500 % éch. 30/11/2024				800	760	0,09		5,410 % éch. 11/07/2023	250	250	0,03	
5,392 % éch. 28/06/2024	3 090	3 069	0,38		3,500 % éch. 15/09/2025				6 700	6 520	0,82		Électricité de France S.A. 5,570 % éch. 14/07/2023	3 700	3 692	0,46	
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 5,362 % éch. 18/10/2024	975	968	0,12		3,875 % éch. 31/03/2025				16 500	16 177	2,03		Enbridge, Inc. 5,400 % éch. 12/07/2023	2 300	2 296	0,29	
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,200 % éch. 02/12/2026	AUD 2 500	1 503	0,19		4,000 % éch. 15/12/2025				6 100	6 006	0,75		5,480 % éch. 17/07/2023	1 000	997	0,13	
5,481 % éch. 03/11/2023	\$ 2 900	2 900	0,36		4,125 % éch. 31/01/2025				41 600	40 953	5,13		J.M. Smucker Co. 5,410 % éch. 17/07/2023	5 300	5 287	0,66	
6,112 % éch. 21/03/2024	500	500	0,06		4,250 % éch. 15/10/2025				20 900	20 670	2,59		L3Harris Technologies, Inc. 5,530 % éch. 21/07/2023	2 900	2 893	0,36	
ONEOK, Inc. 4,550 % éch. 15/07/2028	1 600	1 518	0,19		4,375 % éch. 31/10/2024				23 100	22 825	2,86		Leidos, Inc. 5,900 % éch. 10/07/2023	400	399	0,05	
Pacific Gas & Electric Co. 3,300 % éch. 15/03/2027	300	272	0,03		4,500 % éch. 15/11/2025				5 100	5 074	0,64		Parker Hannifin Corp. 5,400 % éch. 18/07/2023	900	898	0,11	
3,400 % éch. 15/08/2024	100	97	0,01		5,228 % éch. 25/01/2047				165	149	0,02		5,400 % éch. 19/07/2023	900	898	0,11	
3,450 % éch. 01/07/2025	100	94	0,01		TITRES ADOSSES À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX						5,400 % éch. 20/07/2023	900	897	0,11			
3,500 % éch. 15/06/2025	1 700	1 610	0,20		GSR Mortgage Loan Trust 4,070 % éch. 25/09/2035				2	2	0,00		5,400 % éch. 21/07/2023	700	698	0,09	
3,750 % éch. 15/02/2024	200	197	0,02		Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 5,190 % éch. 25/11/2034				3	2	0,00		Penske Truck Leasing Co. LP 5,350 % éch. 11/07/2023	1 500	1 498	0,19	
3,850 % éch. 15/11/2023	200	198	0,02		6,297 % éch. 25/09/2034				278	276	0,03		Thomson Reuters Corp. 5,470 % éch. 18/07/2023	1 200	1 197	0,15	
4,250 % éch. 01/08/2023	2 400	2 398	0,30		WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,470 % éch. 25/01/2033				4	3	0,00						
4,950 % éch. 08/06/2025	2 000	1 940	0,24		5,228 % éch. 25/01/2047				165	149	0,02						
					TITRES ADOSSES À DES ACTIFS						432	0,05					
					Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,770 % éch. 25/12/2035				307	294	0,04						
					4,713 % éch. 20/01/2033				€ 1 000	1 089	0,13						
					ÉMISSIONS SOUVERAINES						1 383	0,17					
					Obligation internationale du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/09/2024				CAD 2 800	2 036	0,26						
					Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % éch. 05/05/2026				\$ 2 000	1 975	0,25						
					Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/03/2025 (c)				€ 9 000	9 279	1,16						
					Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000 % éch. 01/04/2026 (c)				2 700	2 659	0,33						
					République d'Allemagne 2,500 % éch. 13/03/2025				6 700	7 220	0,90						
					Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026				ZAR 139 500	7 669	0,96						
					Bon du Trésor britannique 1,625 % éch. 22/10/2028				£ 7 200	7 861	0,99						
											38 699	4,85					
					ACTIONS												
					ACTIONS ORDINAIRES												
					SERVICES FINANCIERS												
					Stearns Holdings LLC « B » (b)				43 861	0	0,00						
					BONS DE SOUSCRIPTION												
					Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060				211	0	0,00						
					VALEUR NOMINALE (en milliers)												
					INSTRUMENTS À COURT TERME												
					BILLETTS DE TRÉSORERIE												
					American Electric Power Co., Inc. 5,480 % éch. 01/08/2023				\$ 2 000	1 990	0,25						
					1,258 % éch. 01/07/2025				1 200	1 109	0,14						
					AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN												
					Ginnie Mae, TBA 2,500 % éch. 01/08/2053				2 700	2 340	0,29						
											79 458	9,95					
					Total des Obligations et billets privés				581 214	72,81							
					BILLETTS À COURT TERME												
					HF Sinclair Corp. 2,625 % éch. 01/10/2023				1 300	1 289	0,16						
					Total des Instruments à court terme						33 961	4,26					
					Total des Valeurs mobilières						\$ 821 335	102,90					
					ACTIONS												
					FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF												
					PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)				627 529	6 249	0,78						
					PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (d)				5 163	67	0,01						
					Total des Fonds d'investissement						\$ 6 316	0,79					

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 563	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	\$ (574)	\$ 563	\$ 563	0,07
Total des Contrats de mise en pension						\$ (574)	\$ 563	\$ 563	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.

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	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Long	09/2023	109	(187)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	270	(537)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	106	138	0,02
				\$ (549)	(0,07)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ (549)	(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 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	\$ (12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2025	200	(2)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20/12/2023	€ 500	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2023	\$ 800	7	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2024	1 500	47	0,01
Boeing Co.	1,000	20/12/2026	1 300	12	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2027	1 200	75	0,01
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	3 700	(8)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	400	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20/12/2026	80	(5)	0,00
General Motors Co.	5,000	20/06/2028	95	2	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20/06/2028	€ 500	2	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20/12/2023	€ 900	(61)	(0,01)
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/06/2026	300	(4)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	€ 2 200	4	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2025	500	3	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20/12/2023	\$ 1 100	(8)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	200	3	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2028	2 300	7	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20/06/2024	€ 1 200	(12)	0,00
				\$ 50	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.IG-39 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	\$ 4 900	\$ 22	0,00
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	30 800	212	0,03
Indice iTraxx Crossover 39 à 5 ans	5,000	20/06/2028	€ 500	17	0,00
Indice iTraxx Europe Main 39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	13 600	36	0,00
				\$ 287	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	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,399 %	18/06/2028	¥ 77 700	\$ 10	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	\$ 9 400	(426)	(0,05)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,000	14/11/2023	CAD 14 700	(156)	(0,02)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,050	16/11/2023	7 800	(85)	(0,01)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,070	22/11/2023	11 900	(129)	(0,02)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,250	15/06/2024	24 700	(183)	(0,02)

Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit 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	7,300 %	28/04/2027	ZAR 68 300	\$ 147	0,02
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€ 1 700	(76)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	4 400	(459)	(0,06)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	3 200	(300)	(0,04)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	35 100	(67)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	15 800	7	0,00
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,250	19/09/2023	HUF 1 604 100	(23)	0,00
					\$ (1 740)	(0,22)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (1 403)	(0,18)

- (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.

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)	\$ 3	\$ 0	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20/12/2024	700	(16)	11	(5)	0,00
					\$ (19)	\$ 14	\$ (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	07/2023	\$	AUD 85	128	\$ 0	\$ 0	0,00
	08/2023	AUD	128	\$ 85	0	0	0,00
BOA	07/2023	£	370	465	(5)	(5)	0,00
	07/2023	\$	4 409	¥ 636 145	2	2	0,00
	09/2023		606	IDR 9 070 817	(3)	(3)	0,00
BPS	07/2023	AUD	198	\$ 129	(3)	(3)	0,00
	07/2023	€	152 870	164 336	(2 446)	(2 446)	(0,31)
	07/2023	\$	60	AUD 91	0	0	0,00
	07/2023		172 041	€ 157 037	(715)	(715)	(0,09)
	07/2023		3 583	¥ 498 029	(137)	(137)	(0,02)
	07/2023		651	MXN 11 631	27	27	0,00
	08/2023	AUD	91	\$ 61	0	0	0,00
	08/2023	€	150 325	164 942	714	714	0,09
	09/2023	\$	102	IDR 1 536 140	0	0	0,00
	10/2023	ZAR	69 220	\$ 3 729	104	104	0,01
	12/2023	\$	226	MXN 4 038	2	2	0,00
BRC	08/2023		838	COP 3 571 258	6	6	0,00
	09/2023	IDR	10 084	\$ 1	0	0	0,00
	09/2023	\$	280	IDR 4 197 133	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2023	CAD	6 311	\$ 4 631	(138)	(138)	(0,02)
	07/2023	€	1 580	1 695	(28)	(28)	0,00
	07/2023	\$	651	MXN 11 631	27	27	0,00
	08/2023		529	NOK 5 518	(13)	(13)	0,00
DUB	07/2023	£	6 316	\$ 7 875	(155)	(155)	(0,02)
	07/2023	\$	803	BRL 4 348	100	100	0,01
GLM	07/2023	BRL	4 362	\$ 903	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$	22	CHF 19	0	0	0,00
	08/2023		661	NOK 7 015	(5)	(5)	0,00
	08/2023	ZAR	71 904	\$ 3 874	83	83	0,01
	09/2023	\$	903	BRL 4 410	1	1	0,00
	09/2023		2 516	MXN 43 978	11	11	0,00
JPM	07/2023	¥	169 602	\$ 1 186	13	13	0,00
	08/2023	\$	33	CHF 29	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
	08/2023	\$	5 344 ¥	742 124	\$ 0	\$ (179)	\$ (179) (0,02)
	08/2023		244 NOK	2 587	0	(2)	(2) 0,00
	08/2023		401 ZAR	7 335	0	(14)	(14) 0,00
	09/2023		253 IDR	3 803 628	0	0	0 0,00
	09/2023		1 288 INR	106 133	2	0	2 0,00
MBC	07/2023	€	926 \$	992	0	(19)	(19) 0,00
	07/2023	£	17 353	21 481	0	(582)	(582) (0,07)
MYI	07/2023		19	24	0	0	0 0,00
	07/2023	IDR	2 391 180	160	0	0	0 0,00
	07/2023	\$	1 631 €	1 502	8	0	8 0,00
	07/2023		2 532 £	2 037	57	0	57 0,01
	07/2023		159 IDR	2 391 180	0	0	0 0,00
	09/2023		391	5 840 410	0	(3)	(3) 0,00
	09/2023		278 INR	22 924	1	0	1 0,00
RBC	07/2023	MXN	3 315 \$	172	0	(21)	(21) 0,00
SCX	07/2023	\$	125 AUD	188	0	0	0 0,00
	08/2023	AUD	188 \$	125	0	0	0 0,00
	09/2023	\$	720 IDR	10 713 840	0	(8)	(8) 0,00
	09/2023		806 INR	66 378	1	0	1 0,00
TOR	07/2023	AUD	422 \$	276	0	(5)	(5) 0,00
	07/2023	\$	152 AUD	231	1	0	1 0,00
	07/2023		4 770 CAD	6 311	3	(3)	0 0,00
	07/2023		28 012 £	22 045	14	0	14 0,00
	08/2023	AUD	231 \$	153	0	(1)	(1) 0,00
	08/2023	CAD	6 309	4 770	3	(3)	0 0,00
	08/2023	£	22 045	28 018	0	(14)	(14) 0,00
	08/2023	HUF	148 436	424	0	(5)	(5) 0,00
UAG	07/2023	AUD	143	94	0	(2)	(2) 0,00
	07/2023	\$	74 AUD	111	0	0	0 0,00
	08/2023	AUD	111 \$	74	0	0	0 0,00
					\$ 1 180	\$ (4 511)	\$ (3 331) (0,42)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€	1 943 \$	2 124	\$ 4	\$ 4	0,00
	07/2023	\$	164 009 €	152 608	2 486	2 486	0,31
BPS	07/2023	€	154 056 \$	168 798	722	722	0,09
	07/2023	\$	164 765 €	153 248	2 437	(8)	2 429 0,31
	08/2023		168 473	153 543	0	(729)	(729) (0,09)
CBK	07/2023	€	155 370 \$	168 886	0	(622)	(622) (0,08)
	07/2023	\$	3 667 €	3 352	0	(10)	(10) 0,00
	08/2023		166 366	152 807	575	0	575 0,07
JPM	07/2023	€	152 807 \$	166 850	137	0	137 0,02
	07/2023	\$	164 409 €	153 772	3 357	0	3 357 0,42
	08/2023		167 083	152 807	0	(143)	(143) (0,02)
MBC	07/2023	€	812 \$	888	4	(2)	2 0,00
	07/2023	\$	118 €	109	1	0	1 0,00
SCX	07/2023		2 956	2 762	58	0	58 0,01
					\$ 9 781	\$ (1 514)	\$ 8 267 1,04

Au 30 juin 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	07/2023	£	23 \$	29	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$	67 £	53	1	0	1 0,00
BPS	07/2023		9 723	7 861	271	0	271 0,03
BRC	07/2023	£	13 \$	16	0	0	0 0,00
	07/2023	\$	40 £	32	0	0	0 0,00
CBK	07/2023	£	89 \$	113	0	0	0 0,00
	07/2023	\$	27 £	22	0	0	0 0,00
JPM	07/2023	£	7 803 \$	9 867	0	(54)	(54) (0,01)
	08/2023	\$	9 869 £	7 803	54	0	54 0,01
MBC	07/2023	£	3 \$	4	0	0	0 0,00
	07/2023	\$	9 716 £	7 849	262	0	262 0,03
MYI	07/2023		9 695	7 800	222	0	222 0,03
RYL	07/2023		19	15	0	0	0 0,00
TOR	07/2023	£	7 825 \$	9 943	0	(5)	(5) 0,00
	08/2023	\$	9 945 £	7 825	5	0	5 0,00
					\$ 815	\$ (59)	\$ 756 0,09

Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 10 024	NOK 111 442	\$ 378	\$ 0	\$ 378	0,05
CBK	07/2023	NOK 511	\$ 46	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$ 4 982	NOK 56 024	247	0	247	0,03
GLM	07/2023	NOK 46 057	\$ 4 273	0	(26)	(26)	0,00
	07/2023	\$ 26	NOK 283	0	0	0	0,00
	08/2023	4 273	46 012	26	0	26	0,00
				\$ 651	\$ (28)	\$ 623	0,08
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ 6 310	0,79
Total des Investissements						\$ 832 572	104,30
Autres actifs et passifs à court terme						\$ (34 355)	(4,30)
Actifs nets						\$ 798 217	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) Titre à coupon zéro.

(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	\$ 2 616	0,33
Citigroup, Inc.	2,014	25/01/2026	18/01/2022	2 000	1 880	0,24
Citigroup, Inc.	3,290	17/03/2026	10/03/2022	3 200	3 062	0,38
Deutsche Bank AG	1,447	01/04/2025	30/03/2021	1 600	1 521	0,19
Deutsche Bank AG	2,129	24/11/2026	17/11/2020	500	445	0,06
Oracle Corp.	1,650	25/03/2026	22/03/2021	1 899	1 725	0,22
				\$ 11 800	\$ 11 249	1,42

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (31 décembre 2022 : 12 682 \$) 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 30 juin 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 9 374 \$ (31 décembre 2022 : 9 433 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 310 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 821 219	\$ 116	\$ 821 335
Fonds d'investissement	6 316	0	0	6 316
Contrats de mise en pension	0	563	0	563
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	(187)	4 545	0	4 358
Totaux	\$ 6 129	\$ 826 327	\$ 116	\$ 832 572

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 2 863	\$ (2 200)	\$ 663	\$ (35)	\$ 0	\$ (35)
BPS	239	(310)	(71)	(202)	140	(62)
BRC	5	0	5	146	(120)	26
CBK	36	0	36	4 468	(4 360)	108
DUB	(55)	0	(55)	S/O	S/O	S/O
GLM	89	0	89	(12)	16	4
JPM	3 166	(2 550)	616	84	0	84
MBC	(336)	310	(26)	170	(290)	(120)
MYI	285	(320)	(35)	(74)	0	(74)
RBC	(21)	0	(21)	13	0	13
SCX	51	0	51	4 065	(3 850)	215
TOR	(10)	0	(10)	6	(20)	(14)
UAG	(2)	0	(2)	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	71,89	73,17
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	31,01	32,43
Fonds d'investissement	0,79	0,10
Contrats de mise en pension	0,07	0,24
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,07)	0,05
Instruments financiers dérivés compensés	(0,18)	(1,02)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,79	1,30
Titres vendus à découvert	S/O	(2,14)
Contrats de prise en pension	S/O	(1,95)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	S/O	(0,22)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,05	0,55
Obligations et billets privés	72,81	83,16
Obligations et billets municipaux	0,14	0,17
Agences du gouvernement américain	5,66	6,33
Obligations du Trésor américain	14,91	10,55
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	0,05	0,07
Titres adossés à des actifs	0,17	0,22
Émissions souveraines	4,85	3,40
Actions ordinaires	0,00	0,00
Bons de souscription	0,00	0,00
Instruments à court terme	4,26	1,15
Fonds d'investissement	0,79	0,10
Contrats de mise en pension	0,07	0,24
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,07)	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	0,01	(0,03)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,03	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(0,22)	(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	(0,42)	(0,48)
Contrats de change à terme couverts	1,21	1,77
Titres vendus à découvert	S/O	(2,14)
Autres actifs et passifs à court terme	(4,30)	(4,13)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR L'ACTIF NET		
VALEURS MOBILIÈRES			INDUSTRIE			SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			EPR Properties	\$ 8	\$ 7	0,00	NPC Ukrenargo	\$ 200	\$ 43	0,00
American Airlines, Inc.	\$ 900	\$ 920	0,06	4,750 % éch. 15/12/2026	34	30	0,00	6,875 % éch. 09/11/2028 ^		
10,000 % éch. 20/04/2028				4,950 % éch. 15/04/2028				Petroleos de Venezuela S.A.	220	9
Carnival Corp.	€ 3 386	3 685	0,25	GLP Capital LP	100	87	0,01	6,000 % éch. 16/05/2024 ^		0,00
7,168 % éch. 30/06/2025				4,000 % éch. 15/01/2030	3 888	3 706	0,26	Petroleos Mexicanos	4 300	3 145
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	\$ 0	0	0,00	5,300 % éch. 15/01/2029	500	490	0,03	5,950 % éch. 28/01/2031	1 831	1 394
8,584 % - 8,807 % éch. 21/08/2026				HSBC Holdings PLC	5 900	4 899	0,34	6,700 % éch. 16/02/2032		0,10
Emerald TopCo, Inc.	72	71	0,01	2,848 % éch. 04/06/2031				Prime Healthcare Services, Inc.	6 355	6 030
8,584 % éch. 24/07/2026				Nationwide Building Society	2 100	1 948	0,13	7,250 % éch. 01/11/2025	4 100	3 444
Envision Healthcare Corp.	677	807	0,06	4,302 % éch. 08/03/2029				RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.		0,24
16,070 % éch. 29/04/2027				Santander UK Group Holdings PLC	€ 4 169	4 972	0,34	9,750 % éch. 01/12/2026		
16,695 % éch. 28/04/2028 ^	1 648	1 214	0,08	6,750 % éch. 24/06/2024 (h)(j)				Rolls-Royce PLC	£ 1 100	1 300
iHeartCommunications, Inc.	6 168	5 358	0,37	SLM Student Loan Trust	€ 3 162	3 184	0,22	5,750 % éch. 15/10/2027		0,09
8,217 % éch. 01/05/2026				4,076 % éch. 15/12/2033				Royal Caribbean Cruises Ltd.	\$ 876	930
8,469 % éch. 01/05/2026	1 584	1 379	0,10	Société Générale S.A.	\$ 3 200	3 194	0,22	11,500 % éch. 01/06/2025		0,06
Intelsat Jackson Holdings S.A.	814	812	0,06	6,447 % éch. 12/01/2027				Sands China Ltd.	1 400	1 317
9,443 % éch. 01/02/2029				UBS AG	3 490	3 437	0,24	4,300 % éch. 08/01/2026		0,09
Lealand Finance Co. BV	8	7	0,00	5,125 % éch. 15/05/2024 (j)				Surgery Center Holdings, Inc.	1 825	1 868
8,193 % éch. 24/06/2024				UBS Group AG	5 000	4 453	0,31	10,000 % éch. 15/04/2027		0,13
Lealand Finance Co. BV (2,666 % en numéraire ou 3,000 % de rémunération en nature)	24	14	0,00	4,194 % éch. 01/04/2031	2 400	2 385	0,16	T-Mobile USA, Inc.	7 000	6 859
3,000 % - 6,193 % éch. 30/06/2025 (c)				6,373 % éch. 15/07/2026	3 150	3 164	0,22	4,800 % éch. 15/07/2028		0,47
Poseidon BidCo S.A.S.	€ 4 000	4 277	0,29	6,442 % éch. 11/08/2028	€ 1 400	1 694	0,12	Topaz Solar Farms LLC	37	34
8,848 % éch. 14/07/2028				7,750 % éch. 01/03/2029				4,875 % éch. 30/09/2039	199	195
PUG LLC	\$ 29	26	0,00	Unicredit SpA	\$ 12 260	12 334	0,85	5,750 % éch. 30/09/2039		0,01
8,525 % éch. 12/02/2027				7,830 % éch. 04/12/2023				U.S. Renal Care, Inc.	40	10
Syniverse Holdings, Inc.	58	53	0,00	Unique Pub Finance Co. PLC	£ 25	32	0,00	10,625 % éch. 15/07/2027		0,00
12,242 % éch. 13/05/2027				7,395 % éch. 28/03/2024				United Airlines Pass-Through Trust	1 987	1 800
TransDigm, Inc.	0	0	0,00	Uniti Group LP	\$ 1 875	1 329	0,09	3,100 % éch. 07/01/2030	525	482
TBD % éch. 30/05/2025				6,500 % éch. 15/02/2029	2 508	2 490	0,17	4,150 % éch. 25/02/2033	3 378	3 353
TBD % éch. 09/12/2025	0	0	0,00	10,500 % éch. 15/02/2028				5,875 % éch. 15/04/2029		0,23
8,492 % éch. 24/08/2028	12 047	12 054	0,83	VICI Properties LP	2 000	1 891	0,13	Valaris Ltd.	942	946
U.S. Renal Care, Inc.	293	138	0,01	4,500 % éch. 01/09/2026	4 325	3 978	0,27	8,375 % éch. 30/04/2030		0,07
10,192 % éch. 26/06/2026				4,500 % éch. 15/01/2028	4 900	4 453	0,31	Venture Global Calcasieu Pass LLC	300	262
Westmoreland Coal Co. (15,000 % de rémunération en nature)	13	9	0,00	4,625 % éch. 01/12/2029				3,875 % éch. 15/08/2029	300	258
TBD % éch. 15/03/2029 (c)								4,125 % éch. 15/08/2031		0,02
Windstream Services LLC	3	3	0,00					Venture Global LNG, Inc.	900	915
11,452 % éch. 21/09/2027								8,125 % éch. 01/06/2028	900	909
Wm Morrison Supermarkets Ltd.	€ 2 374	2 229	0,15					8,375 % éch. 01/06/2031		0,06
8,073 % éch. 04/11/2027								Viking Cruises Ltd.	3 600	3 783
		33 056	2,27					13,000 % éch. 15/05/2025	2 373	1 972
								Windstream Escrow LLC		0,14
								7,750 % éch. 15/08/2028		80 971
										5,57
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS										
BANQUE ET FINANCE										
Adler Financing SARL	5 771	6 463	0,44	Alaska Airlines Pass-Through Trust	2 090	2 011	0,14	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC	€ 11 000	9 301
12,500 % éch. 30/06/2025				4,800 % éch. 15/02/2029				2,950 % éch. 15/04/2025		0,64
AGPS BondCo PLC	8 300	3 212	0,22	Altice France S.A.	3 400	2 948	0,20	Pacific Gas & Electric Co.	\$ 3 785	3 236
5,000 % éch. 27/04/2027 ^				8,125 % éch. 01/02/2027				2,100 % éch. 01/08/2027	1 772	1 624
Avolon Holdings Funding Ltd.	\$ 1 340	1 131	0,08	American Airlines Pass-Through Trust	60	54	0,00	2,950 % éch. 01/03/2026 ^	773	702
2,528 % éch. 18/11/2027				3,375 % éch. 01/11/2028				3,300 % éch. 15/03/2027 ^	7 662	6 724
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	€ 3 000	2 915	0,20	British Airways Pass-Through Trust	467	427	0,03	3,300 % éch. 01/12/2027 ^	2 173	2 103
1,875 % éch. 09/01/2026				4,250 % éch. 15/05/2034				3,400 % éch. 15/08/2024 ^	1 869	1 765
2,625 % éch. 28/04/2025	1 980	2 028	0,14	Broadcom, Inc.	2 453	2 013	0,14	3,450 % éch. 01/07/2025	1 437	1 361
6,750 % éch. 02/03/2026	2 654	2 902	0,20	3,469 % éch. 15/04/2034				3,500 % éch. 15/06/2025 ^	1 490	1 466
8,000 % éch. 22/01/2030	481	472	0,03	Carvana Co.	120	80	0,01	3,750 % éch. 15/02/2024 ^	1 459	1 309
Banco de Credito del Peru S.A.	PEN 600	159	0,01	5,500 % éch. 15/04/2027	3 700	2 919	0,20	3,750 % éch. 01/07/2028	12	8
4,650 % éch. 17/09/2024				10,250 % éch. 01/05/2030				4,000 % éch. 15/08/2042 ^	2	1
Barclays PLC	\$ 1 355	1 351	0,09	CDW LLC	6 460	5 808	0,40	4,300 % éch. 15/03/2045 ^	61	44
6,224 % éch. 09/05/2034				2,670 % éch. 01/12/2026				4,450 % éch. 15/04/2042 ^	66	50
Bevco Lux SARL	€ 4 400	3 745	0,26	Community Health Systems, Inc.	4 054	3 576	0,25	4,500 % éch. 15/12/2041 ^	26	19
1,000 % éch. 16/01/2030				5,625 % éch. 15/03/2027				4,550 % éch. 01/07/2030	4 717	4 273
Corsair International Ltd.	1 000	1 086	0,07	8,000 % éch. 15/03/2026	742	724	0,05	4,950 % éch. 08/06/2025	2 600	2 521
7,772 % éch. 28/01/2027				CoStar Group, Inc.	1 300	1 074	0,07	4,950 % éch. 01/07/2020	1 381	1 087
Credit Suisse AG	3 200	3 548	0,24	2,800 % éch. 15/07/2030				Rio Oil Finance Trust	904	909
5,500 % éch. 20/08/2026				DISH DBS Corp.	2 550	2 050	0,14	8,200 % éch. 06/04/2028	517	534
Credit Suisse AG	\$ 1 900	76	0,01	5,250 % éch. 01/12/2026	2 520	1 879	0,13	9,750 % éch. 06/01/2027		0,04
AT1 Claim ^				5,750 % éch. 01/12/2028				Sprint LLC	2 868	2 896
Cromwell Ereit Lux Finco SARL	€ 167	157	0,01	Intelsat Jackson Holdings S.A.	3 297	3 010	0,21	7,125 % éch. 15/06/2024		0,20
2,125 % éch. 19/11/2025				6,500 % éch. 15/03/2030						41 933
Deutsche Bank AG	\$ 1 200	997	0,07	JetBlue Pass-Through Trust	2 760	2 521	0,17			2,88
3,547 % éch. 18/09/2031				4,000 % éch. 15/05/2034				Total des Obligations et billets privés		217 503
6,720 % éch. 18/01/2029	200	200	0,01	Market Bidco Finco PLC	€ 2 100	1 850	0,13			14,95
				4,750 % éch. 04/11/2027						
				Mitchells & Butlers Finance PLC	£ 36	41	0,00			
				6,013 % éch. 15/12/2030						
				Motorola Solutions, Inc.	\$ 4 383	3 543	0,24			
				2,300 % éch. 15/11/2030						
				Nissan Motor Co. Ltd.	2 800	2 549	0,18			
				4,345 % éch. 17/09/2027	300	263	0,02			
				4,810 % éch. 17/09/2030						
				NMG Holding Co., Inc.	400	373	0,03			
				7,125 % éch. 01/04/2026						

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET	DESCRIPTION	ACTIONS (en milliers)	JUSTE EN % DE VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET
GSAMP Trust				ÉMISSIONS SOUVERAINES				Windstream Holdings II, LLC - Exp.			
5,870 % éch. 25/11/2035	\$ 2 100	\$ 1 699	0,12	Obligation internationale du gouvernement argentin				21/09/2055	361	\$ 6	0,00
Harvest SBA Loan Trust				0,500 % éch. 09/07/2030	\$ 2 796	\$ 854	0,06				
7,388 % éch. 25/08/2044	163	159	0,01	1,000 % éch. 09/07/2029	120	39	0,00				7 0,00
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				1,500 % éch. 09/07/2035	1 732	510	0,03	SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER			
5,310 % éch. 25/07/2037	377	202	0,01	3,500 % éch. 09/07/2041	3 129	1 008	0,07	CBL & Associates Properties, Inc.	174	4	0,00
5,350 % éch. 25/07/2037	5 053	2 712	0,19	15,500 % éch. 17/10/2026	ARS 1 188	0	0,00	Uniti Group, Inc.	247	1	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust				Obligation internationale du gouvernement australien							5 0,00
5,290 % éch. 25/12/2036	8 705	7 316	0,50	1,750 % éch. 21/06/2051	AUD 2 500	969	0,07				
5,340 % éch. 25/01/2037	2 866	1 982	0,14	Ville autonome de Buenos Aires							
IXIS Real Estate Capital Trust				95,317 % éch. 29/03/2024 (a)	ARS 610	1	0,00	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
5,610 % éch. 25/01/2037	3 423	1 245	0,08	Obligation internationale du gouvernement péruvien				INSTRUMENTS À COURT TERME			
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				5,350 % éch. 12/08/2040	PEN 1 022	237	0,01	BILLETTS À COURT TERME			
5,410 % éch. 25/06/2037	335	334	0,02	5,400 % éch. 12/08/2034	1	0	0,00	Federal Home Loan Bank			
Lehman XS Trust				6,150 % éch. 12/08/2032	88	23	0,00	5,170 % éch. 29/11/2023	\$ 27 300	27 312	1,87
5,670 % éch. 25/05/2046 ^	1 393	1 244	0,09	6,950 % éch. 12/08/2031	59	17	0,00	BONS DU TRÉSOR ARGENTIN			
6,500 % éch. 25/06/2046	50	42	0,00	Provincia de Buenos Aires				(28,578) % éch. 18/10/2023			
7,450 % éch. 25/12/2037	1 298	1 315	0,09	88,734 % éch. 12/04/2025 (a)	ARS 6 240	11	0,00	(e)(f)	ARS 75 997	150	0,01
Long Beach Mortgage Loan Trust				Obligation internationale du gouvernement roumain				(12,549) % éch. 23/11/2023	270 916	547	0,04
5,430 % éch. 25/06/2036	481	441	0,03	2,000 % éch. 14/04/2033	€ 2 500	1 932	0,13	(e)(f)			
5,750 % éch. 25/01/2036	3 069	2 799	0,19	3,750 % éch. 07/02/2034	1 200	1 061	0,07	(e)(f)			697 0,05
Man GLG Euro CLO DAC				Obligation internationale du gouvernement russe				BONS DU TRÉSOR JAPONAIS			
3,617 % éch. 15/10/2030	€ 2 908	3 109	0,21	4,250 % éch. 23/06/2027 ^	\$ 5 600	2 436	0,17	(0,206) % éch. 18/07/2023 (e)(f)	¥ 193 000	1 335	0,09
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				4,750 % éch. 27/05/2026 ^	200	101	0,01	(0,200) % éch. 24/07/2023 (e)(f)	330 000	2 283	0,16
5,430 % éch. 25/05/2037	\$ 4 400	2 332	0,16	5,250 % éch. 23/06/2047 ^	200	89	0,01	(0,199) % éch. 11/09/2023 (e)(f)	1 523 000	10 540	0,72
5,450 % éch. 25/08/2037	283	265	0,02	5,250 % éch. 23/06/2047 ^	400	24	0,00	(0,197) % éch. 31/07/2023 (e)(f)	93 000	644	0,05
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				7,150 % éch. 12/11/2025 ^	RUB 19 414	114	0,01	(0,197) % éch. 28/08/2023 (e)(f)	2 220 000	15 363	1,06
3,580 % éch. 25/01/2035	1 330	1 022	0,07	7,950 % éch. 07/10/2026 ^	13 158	77	0,01	(0,188) % éch. 18/07/2023 (e)(f)	92 000	637	0,04
5,350 % éch. 25/05/2037	927	513	0,03	Obligation internationale du gouvernement sud-africain				(0,184) % éch. 04/09/2023 (e)(f)	510 000	3 529	0,24
5,450 % éch. 25/06/2036	1 856	1 568	0,11	10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 193 200	10 622	0,73	(0,179) % éch. 11/09/2023 (e)(f)	340 000	2 353	0,16
6,065 % éch. 25/03/2035	829	817	0,06	Obligation internationale du gouvernement turc				(0,178) % éch. 31/07/2023 (e)(f)	27 000	187	0,01
New Century Home Equity Loan Trust				4,250 % éch. 13/03/2025	\$ 1 200	1 122	0,08	(0,169) % éch. 19/09/2023 (e)(f)	750 000	5 190	0,36
5,870 % éch. 25/10/2035	439	420	0,03	5,250 % éch. 13/03/2030	1 000	823	0,06	(0,150) % éch. 25/09/2023 (e)(f)	691 000	4 782	0,33
NovaStar Mortgage Funding Trust				5,750 % éch. 11/05/2047	741	508	0,03				
6,725 % éch. 25/12/2034	3 425	3 255	0,22	Obligation internationale du gouvernement vénézuélien							46 843 3,22
Oak Hill European Credit Partners DAC				8,250 % éch. 13/10/2024 ^	2 000	185	0,01	Total des Instruments à court terme			
3,930 % éch. 20/01/2032	€ 2 596	2 768	0,19	9,000 % éch. 07/05/2023 ^	1 600	144	0,01				74 852 5,14
OHA Loan Funding Ltd.								Total des Valeurs mobilières	\$ 1 708 028	117,36	
6,363 % éch. 23/07/2031	\$ 3 000	2 974	0,20			22 907	1,57				
Option One Mortgage Loan Trust				ACTIONS				ACTIONS			
5,400 % éch. 25/03/2037	4 999	2 470	0,17	ACTIONS ORDINAIRES				FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
5,915 % éch. 25/08/2035	2 000	1 888	0,13	SERVICES DE COMMUNICATION				PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)	14 658 227	145 966	10,03
6,575 % éch. 25/11/2034	835	833	0,06	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d)	173 174	237	0,02				
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				iHeartMedia, Inc. « A » (d)	41 444	151	0,01				
6,725 % éch. 25/02/2035	8 704	8 417	0,58	iHeartMedia, Inc. « B » (d)	32 182	105	0,01				
People's Choice Home Loan Securities Trust				Intelsat Emergence S.A. (d)(k)	45 479	1 046	0,07				
7,175 % éch. 25/10/2034	477	390	0,03			1 539	0,11				
Pretium Mortgage Credit Partners LLC				BIENS DE CONSOMMATION COURANTE							
2,487 % éch. 25/07/2051	1 985	1 842	0,13	Neiman Marcus Group Ltd. LLC (d)(k)	5 145	782	0,05				
Renaissance Home Equity Loan Trust				INDUSTRIE							
5,580 % éch. 25/11/2036	1 235	454	0,03	Westmoreland Mining Holdings LLC (d)(k)	231	1	0,00				
Residential Asset Mortgage Products Trust				IMMOBILIER							
6,230 % éch. 25/03/2035	2 000	1 902	0,13	Adler Group S.A. (d)	64 865	34	0,00				
Saxon Asset Securities Trust				Adler Group S.A.	143 630	87	0,01				
5,490 % éch. 25/10/2046	4 845	4 685	0,32			121	0,01				
SoFi Professional Loan Program LLC						2 443	0,17				
2,630 % éch. 25/07/2040	197	195	0,01	DROITS							
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025	9 740	58	0,00				
5,350 % éch. 25/11/2037	366	203	0,01	BONS DE SOUSCRIPTION							
Starwood Commercial Mortgage Trust				Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17/02/2027	661	1	0,00				
6,296 % éch. 15/07/2038	6 260	6 207	0,43								
Structured Asset Investment Loan Trust											
5,870 % éch. 25/01/2036	471	450	0,03								
6,150 % éch. 25/09/2034	1 926	1 877	0,13								
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust											
5,380 % éch. 25/05/2047	192	182	0,01								
6,125 % éch. 25/05/2035	2 900	2 840	0,19								
Terwin Mortgage Trust											
6,530 % éch. 25/03/2035	406	378	0,03								
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust											
5,900 % éch. 25/12/2035	701	685	0,05								
6,875 % éch. 25/11/2035	5 050	4 972	0,34								
		113 215	7,78								

* L'exposition du Fonds Low Duration Income Fund aux Fonds d'investissement a légèrement dépassé 10 %. Le Fonds est revenu au niveau conforme le 3 juillet 2023.

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	5,120 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 276 200	Billets du Trésor américain 0,250 % échéance 31/07/2025	\$ (281 598)	\$ 276 200	\$ 276 318	18,97
	5,170	30/06/2023	03/07/2023	46 400	Ginnie Mae 2,500 % échéance 20/10/2051	(48 032)	46 400	46 420	3,19
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	3 892	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	(3 970)	3 892	3 892	0,27
Total des Contrats de mise en pension						\$ (333 600)	\$ 326 492	\$ 326 630	22,43

(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	42	\$ 280	0,02
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2025	22	97	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2026	23	75	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	29	170	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2025	22	80	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2024	35	224	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2025	20	79	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2026	21	65	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2024	26	132	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2025	17	58	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	53	73	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	81	168	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	927	1 857	0,12
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Long	09/2023	23	(26)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Court	09/2023	16	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	82	(136)	(0,01)
				\$ 3 194	0,22

OPTIONS VENDUES**OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	80	\$ (35)	\$ (30)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	80	(28)	(4)	0,00
Option de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	123,000	21/07/2023	15	(6)	(2)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	131,000	21/07/2023	15	(8)	(3)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,000	15/09/2023	33	(54)	(2)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,063 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,063	15/12/2023	35	(72)	(7)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,125 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,125	15/12/2023	33	(61)	(7)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,188 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,188	15/09/2023	50	(97)	(3)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,375 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,375	15/12/2023	50	(104)	(8)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	98,000	15/12/2023	50	(41)	(3)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,000	15/09/2023	33	(63)	(116)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,063 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,063	15/12/2023	35	(68)	(129)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,125 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,125	15/12/2023	33	(63)	(126)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,188 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,188	15/09/2023	50	(99)	(199)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,375 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,375	15/12/2023	50	(106)	(221)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	50	(47)	(236)	(0,02)
				\$ (952)	\$ (1 096)	(0,07)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					\$ 2 098	0,15

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	\$ 205	0,02
Airbus Finance BV	1,000	20/06/2026	3 100	(31)	0,00
Airbus Finance BV	1,000	20/06/2028	200	(1)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2025	\$ 700	22	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2025	2 500	(15)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	1 500	(12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	600	4	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2023	1 000	9	0,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

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 Co.	5,000 %	20/12/2024	\$ 2 600	\$ (100)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2025	100	3	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	9	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	400	30	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	4 700	22	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2025	€ 2 400	236	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2027	1 100	60	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2026	\$ 3 000	(45)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2026	400	(7)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2028	4 300	15	0,00
				\$ 409	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 à 5 ans	1,000 %	20/06/2024	\$ 688	\$ 27	0,00
Indice CDX.EM-32 à 5 ans	1,000	20/12/2024	510	23	0,00
Indice CDX.EM-34 à 5 ans	1,000	20/12/2025	1 196	6	0,00
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000	20/12/2026	12 972	253	0,02
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	1 300	57	0,00
Indice CDX.EM-39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	2 700	71	0,01
Indice CDX.HY-36 à 5 ans	5,000	20/06/2026	5 782	(247)	(0,02)
Indice CDX.HY-37 à 5 ans	5,000	20/12/2026	2 254	(11)	0,00
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	11 187	189	0,01
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	5,000	20/06/2028	58 600	1 597	0,12
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	2 300	16	0,00
				\$ 1 981	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	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,060 %	21/02/2052	£ 300	\$ (179)	(0,01)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,096	14/02/2052	600	(354)	(0,02)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,101	21/02/2052	300	(176)	(0,01)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,175	28/02/2052	600	(342)	(0,02)
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250	20/09/2053	1 900	170	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/03/2029	¥ 8 473 000	493	0,03
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,176	27/04/2027	550 000	1	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	2 140 000	162	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2042	1 140 000	246	0,02
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,711	27/04/2042	140 000	38	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/07/2023	\$ 3 600	49	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	02/08/2023	1 000	14	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/08/2023	283 500	3 911	0,27
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	09/08/2023	1 100	(15)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	06/09/2023	6 400	89	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	12/09/2023	15 700	(219)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	16/09/2023	56 300	(803)	(0,05)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	16/09/2023	400	6	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2026	32 600	2 843	0,20
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2026	56 300	5 046	0,35
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2028	10 869	(1 109)	(0,08)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	16/06/2031	76 933	(8 543)	(0,60)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,928	06/05/2026	2 200	212	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,940	08/06/2026	2 900	269	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	3 600	266	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	4 070	368	0,03
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	16/12/2030	20 713	4 263	0,29
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,030	17/06/2026	3 600	323	0,02
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,235	12/05/2028	1 100	139	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	17/06/2030	4 400	462	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	22 690	(2 238)	(0,15)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/12/2050	12 600	3 739	0,26
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/06/2051	8 700	2 023	0,14
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,270	04/11/2023	283 500	(4 649)	(0,32)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,317	16/12/2050	400	(149)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,360	15/02/2027	6 700	655	0,05
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,360	20/07/2031	1 400	245	0,02
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,370	19/07/2031	900	157	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,380	04/01/2027	3 600	(375)	(0,03)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,418	20/01/2027	1 300	(125)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,425	18/01/2027	2 500	(237)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,438	22/01/2051	9 000	(3 185)	(0,22)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,450	17/02/2027	6 300	597	0,04
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,450	16/07/2031	2 000	342	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 ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500%	15/12/2028	\$ 7 919	\$ (1 112)	(0,08)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	18/12/2029	1 200	123	0,01
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	05/10/2031	1 500	(247)	(0,02)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	17/06/2050	7 700	3 765	0,26
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,518	20/01/2029	800	(99)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,535	15/10/2031	1 500	(243)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,535	22/10/2031	1 000	(161)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,545	26/10/2031	1 000	(161)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,570	12/01/2027	1 400	(128)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,580	16/02/2027	2 800	(246)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,580	13/01/2051	9 300	(3 127)	(0,21)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,600	16/01/2026	17 200	630	0,04
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,600	15/02/2027	26 800	(2 321)	(0,16)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,625	06/01/2030	300	46	0,00
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,630	26/01/2029	1 300	(153)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,650	08/02/2032	1 700	(258)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,655	24/01/2032	1 300	(202)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	06/03/2024	6 400	(152)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	17/02/2027	25 000	(2 076)	(0,14)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,730	24/02/2032	1 600	(232)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,735	12/01/2032	1 100	(166)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2025	38 000	1 154	0,08
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	3 538	164	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/01/2030	4 600	642	0,04
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	1 608	68	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	28 100	3 956	0,27
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,765	16/03/2032	600	(84)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,768	02/02/2032	1 000	(152)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,783	22/04/2027	2 100	(178)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,785	12/08/2051	1 100	349	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,788	03/05/2027	2 300	(193)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,815	24/01/2052	300	(88)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,867	26/01/2052	300	(85)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,910	17/10/2049	400	121	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,988	09/02/2032	1 100	145	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2027	2 100	49	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	10/12/2029	21 000	2 486	0,17
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	11/12/2029	11 170	143	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	12/02/2030	2 500	323	0,02
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	10/03/2030	1 200	133	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	17 930	494	0,03
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,008	09/02/2032	1 900	243	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,250	17/06/2027	5 600	(356)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,250	12/03/2050	15 700	3 518	0,24
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,300	17/01/2026	12 300	446	0,03
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,350	17/01/2025	21 900	511	0,04
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,385	08/06/2032	1 400	115	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,436	08/06/2032	6 800	539	0,04
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	43 700	1 037	0,07
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,450	04/10/2027	5 430	414	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,451	08/06/2032	8 700	680	0,05
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,543	05/02/2024	1 000	16	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,550	05/02/2024	1 000	16	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,559	05/02/2024	1 000	16	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,571	05/02/2024	500	8	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,580	05/02/2024	1 500	23	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,605	05/02/2024	1 500	23	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,605	28/06/2027	3 900	(192)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,607	05/02/2024	500	8	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	19/12/2023	19 100	(42)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,900	04/10/2027	15 500	(748)	(0,05)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	19/06/2024	24 000	1 210	0,08
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	19/06/2026	12 700	981	0,07
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2030	85 750	3 413	0,23
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	7 110	257	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	270	(7)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	07/09/2027	1 400	(60)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	1 400	(60)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	06/09/2032	2 000	(86)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,080	23/02/2053	1 200	(22)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	1 400	(56)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	43 820	1 295	0,09
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,300	06/03/2033	2 000	(47)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,340	23/02/2030	3 200	(79)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,350	14/12/2032	500	15	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,370	01/03/2033	2 000	(34)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,400	23/02/2033	3 200	(47)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,405	01/03/2033	2 100	(30)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,420	24/05/2033	7 600	(71)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,430	27/02/2033	2 100	(26)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,450	07/03/2033	3 900	(42)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	3 900	(65)	0,00

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	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500%	21/06/2026	\$ 6 720	\$ 178	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/06/2030	12 200	(109)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2030	8 700	57	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/05/2033	29 710	(447)	(0,03)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	21/06/2033	8 100	(6)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,610	12/12/2032	1 100	9	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,700	06/06/2033	66 350	(164)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	20/12/2028	13 900	84	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	2 000	(17)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,040	20/06/2024	7 900	(60)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,060	20/06/2024	31 700	(234)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,140	22/06/2024	13 200	(87)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,500	22/05/2025	65 120	3	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,900	06/06/2025	144 940	(69)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	5,100	22/05/2024	125 980	52	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	5,400	06/06/2024	281 160	245	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,140	02/01/2025	BRL 100	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,160	02/01/2025	100	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,220	04/01/2027	200	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,245	04/01/2027	100	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,260	04/01/2027	100	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,350	02/01/2025	100	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,715	04/01/2027	200	1	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,870	04/01/2027	500	3	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,000	02/01/2025	300	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,015	04/01/2027	57 400	406	0,03
À payer	CDI BRL à 1 an	12,080	02/01/2025	500	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,140	02/01/2025	300	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,145	02/01/2025	300	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,160	02/01/2025	500	1	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/07/2023	\$ 3 600	(48)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	02/08/2023	1 000	(14)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/08/2023	283 500	(3 889)	(0,27)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	09/08/2023	1 100	15	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	06/09/2023	6 400	(90)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	12/09/2023	15 700	222	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	16/09/2023	56 300	809	0,06
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	16/09/2023	400	(6)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/09/2023	21 731	285	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/09/2023	76 933	(958)	(0,07)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,928	06/08/2023	2 200	24	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,940	08/09/2023	2 900	34	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/09/2023	20 713	245	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,030	17/09/2023	3 600	40	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,235	12/08/2023	1 100	12	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/09/2023	21 300	233	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/09/2023	4 400	47	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	20/07/2023	1 400	9	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	15/08/2023	6 700	46	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,370	19/07/2023	900	6	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,418	20/07/2023	1 300	(8)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,425	18/07/2023	2 500	(16)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,438	22/07/2023	9 000	(56)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	16/07/2023	2 000	12	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	17/08/2023	6 300	41	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	05/07/2023	1 500	(14)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/09/2023	7 919	(83)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	17/09/2023	7 700	78	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/09/2023	1 200	12	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/07/2023	800	(5)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	15/07/2023	1 500	(14)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	22/07/2023	1 000	(10)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,545	26/07/2023	1 000	(10)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	12/07/2023	1 400	(8)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,580	13/07/2023	9 300	(51)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,580	16/08/2023	2 800	(16)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,600	15/08/2023	26 800	(152)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,625	06/07/2023	300	2	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/07/2023	1 300	(7)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,655	24/07/2023	1 300	(7)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	17/08/2023	25 000	(130)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,735	12/07/2023	1 100	(5)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	15/07/2023	4 600	21	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,785	12/08/2023	1 100	6	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,815	24/07/2023	300	(1)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,867	26/07/2023	300	(1)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,910	17/07/2023	400	3	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	12/08/2023	2 500	10	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	10/09/2023	22 200	195	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,008	09/08/2023	1 900	7	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,543	05/08/2023	1 000	1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,550	05/08/2023	1 000	1	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	LIBOR USD à 3 mois	2,559%	05/08/2023	\$ 1 000	\$ 1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,571	05/08/2023	500	1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,580	05/08/2023	1 500	2	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,605	05/08/2023	1 500	1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,607	05/08/2023	500	0	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,750	19/09/2023	19 100	136	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	3,000	19/09/2023	36 700	234	0,02
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,000	21/03/2027	AUD 12 400	(651)	(0,04)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,250	18/03/2050	€ 2 500	1 088	0,07
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,294	30/06/2026	100	12	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,329	30/12/2025	200	21	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,363	30/06/2025	300	26	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,395	30/12/2024	200	14	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,425	28/06/2024	300	14	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,453	29/12/2023	400	11	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,500	17/06/2050	600	280	0,02
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	2 400	(107)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	14 200	(1 478)	(0,10)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	4 800	(503)	(0,03)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052	27 100	1 174	0,08
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	9 800	(919)	(0,06)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	4 700	(441)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	21/09/2027	3 500	(209)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	11/04/2024	9 900	(155)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	13/04/2024	15 000	(237)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	17/05/2024	8 600	(146)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	26/04/2024	9 900	(137)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	9 200	(137)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	9 600	(143)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	4 900	(109)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	11 600	(103)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,000	15/09/2031	£ 900	(169)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,020	15/10/2031	1 200	(218)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,055	15/09/2031	800	(149)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,066	15/09/2031	1 700	(286)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,140	15/10/2031	2 300	(382)	(0,03)
					\$ 13 070	0,89
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 15 460	1,06

(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.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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	1 100	\$ 178	\$ 129	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	319	0,02
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,053	20/07/2023	15 900	96	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,053	20/07/2023	15 900	96	350	0,02
	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	27	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	247	0,02
	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	42	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	155	287	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	1 200	158	100	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	1 400	185	230	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	1 200	190	144	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	271	0,02
							\$ 1 933	\$ 2 146	0,15

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

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 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	6 000	\$ (19)	\$ (1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	6 000	(19)	(81)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,380	31/07/2023	2 800	(11)	(13)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	2 800	(11)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	2 800	(18)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	2 800	(18)	(2)	0,01
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,060	14/07/2023	1 000	(7)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,360	14/07/2023	1 000	(7)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	2 300	(7)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	2 300	(7)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	3 600	(25)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	3 600	(25)	0	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	1 200	(4)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	1 200	(4)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	1 400	(3)	(3)	0,00
CBK	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	1 400	(3)	(5)	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	2 100	(17)	(2)	0,00
DUB	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)	(39)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	4 800	(29)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	4 800	(29)	(103)	(0,01)
	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)	(4)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,790	08/04/2024	3 300	(25)	(57)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,765	25/07/2023	6 900	(43)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,765	25/07/2023	6 900	(43)	(172)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,468	25/07/2023	1 500	(36)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,468	25/07/2023	1 500	(36)	(94)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	4 800	(30)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	4 800	(30)	(103)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	3 900	(25)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	3 900	(25)	(79)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	3 900	(27)	(1)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	3 900	(27)	(75)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	3 900	(27)	(1)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	3 900	(27)	(73)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	3 900	(27)	(1)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	3 900	(27)	(72)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	3 900	(27)	(1)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	3 900	(27)	(81)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	3 800	(26)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	3 800	(26)	(83)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	3 800	(28)	(1)	0,01
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	3 800	(28)	(73)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	3 700	(25)	(1)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	3 700	(25)	(77)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	7 200	(26)	(1)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	7 200	(26)	(94)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	7 200	(25)	(1)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	7 200	(25)	(100)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	6 100	(19)	(1)	0,01
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	6 100	(19)	(76)	(0,01)
	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	(97)	(15)	0,00
GLM	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	(97)	(226)	(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)	(5)	0,00
GLM	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)	(74)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	2 300	(8)	(5)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	2 300	(8)	(11)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	1 400	(3)	(3)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	1 400	(3)	(5)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,050	19/07/2023	6 900	(41)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,050	19/07/2023	6 900	(41)	(153)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,052	20/07/2023	6 900	(42)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,052	20/07/2023	6 900	(42)	(152)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,700	19/07/2023	1 500	(35)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,700	19/07/2023	1 500	(35)	(79)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,675	20/07/2023	1 500	(35)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,675	20/07/2023	1 500	(35)	(81)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	4 400	(30)	(1)	0,01
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	4 400	(30)	(93)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	2 300	(7)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	2 300	(7)	(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	10/07/2023	4 000	(14)	(1)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	10/07/2023	4 000	(14)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	2 200	(7)	(4)	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	2 200	(7)	(9)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,550	19/07/2023	400	(29)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,550	19/07/2023	400	(29)	(47)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,537	20/07/2023	400	(29)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,537	20/07/2023	400	(29)	(48)	0,00
							\$ (1 928)	\$ (2 619)	(0,18)

OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉ

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 plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 1 an	0,030 %	24/07/2024	15 900	\$ (119)	\$ (350)	(0,02)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 1 an	0,030	24/07/2024	15 900	(119)	(4)	0,00
	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 1 an	0,026	23/07/2025	15 900	(139)	(254)	(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	15 900	(139)	(36)	0,00
	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote ⁽²⁾	LIBOR USD à 2 ans	0,026	23/07/2026	11 300	(200)	(321)	(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	11 300	(200)	(75)	(0,01)
						\$ (916)	\$ (1 040)	(0,07)

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

(2) L'instrument sous-jacent a une date d'entrée en vigueur différée.

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)	\$ 8	\$ (4)	0,00
BPS	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	500	(45)	23	(22)	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)	22	(19)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	200	(13)	12	(1)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	640	(82)	57	(25)	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	400	(14)	2	(12)	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)	0	(4)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	500	(18)	3	(15)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	300	(27)	14	(13)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2025	200	(11)	8	(3)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	700	(79)	52	(27)	0,00
HUS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2023	300	(10)	11	1	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	700	(27)	6	(21)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	800	(71)	36	(35)	(0,01)
	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)	12	(50)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	100	(16)	14	(2)	0,00
					\$ (541)	\$ 297	\$ (244)	(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
GST	Indice CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500 %	16/12/2072	\$ 62 300	\$ 92	\$ (1 027)	\$ (935)	(0,06)
MEI	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	15 300	(74)	(95)	(169)	(0,01)
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	25 375	(78)	(25)	(103)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	25 375	(193)	16	(177)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	300	(2)	(1)	(3)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16/12/2072	25 500	86	(469)	(383)	(0,03)
					\$ (169)	\$ (1 601)	\$ (1 770)	(0,12)

(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	07/2023	KRW	223 531	\$ 171	\$ 1	\$ 1	0,00
	07/2023	\$	6 450	MXN 118 750	456	456	0,03
	08/2023	AUD	73	\$ 48	0	0	0,00
	08/2023	£	1 313	1 648	0	(21)	0,00
	08/2023	¥	1 058 165	7 674	292	292	0,02
	08/2023	\$	11 982	AUD 17 725	0	(169)	(0,01)
	08/2023		1 034	€ 959	14	14	0,00
	08/2023		1 506	NZD 2 375	0	(51)	0,00
	09/2023	¥	1 441 000	\$ 10 300	208	208	0,01
	09/2023	TWD	46 342	1 527	36	36	0,00
	09/2023	\$	632	IDR 9 457 672	0	(4)	0,00
	09/2023		1 260	KRW 1 596 349	0	(43)	0,00
BPS	07/2023	KRW	33 984	\$ 26	0	0	0,00
	08/2023	CNH	541	78	4	4	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
	08/2023	KRW	\$	2 227 911	1 699	\$ 6	0,00
	08/2023	TWD		23 196	760	15	0,00
	08/2023	\$	CNH	92	642	0	0,00
	08/2023		€	684	625	(1)	0,00
	08/2023		INR	1 944	159 719	1	0,00
	08/2023	ZAR	\$	89 047	4 848	153	0,01
	09/2023	\$	IDR	232	3 489 845	0	0,00
	10/2023	ZAR	\$	47 252	2 539	64	0,00
BRC	07/2023	¥		285 000	2 203	228	0,02
	07/2023	KRW		224 770	172	1	0,00
	07/2023	\$	BRL	1 265	6 050	0	0,00
	08/2023	£	\$	18 058	22 665	(298)	(0,02)
	08/2023	\$	CNH	173	1 196	0	0,00
	08/2023		¥	3 833	507 304	(301)	(0,02)
	08/2023	ZAR	\$	4 892	265	7	0,00
	09/2023	IDR		18 085	1	0	0,00
	09/2023	¥		510 000	3 726	164	0,01
CBK	07/2023	BRL		5 713	1 191	6	0,00
	07/2023	PEN		357	98	0	0,00
	07/2023	\$	PEN	92	357	7	0,00
	08/2023	AUD	\$	79	53	0	0,00
	08/2023	€		1 137	1 244	1	0,00
	08/2023	¥		1 161 835	8 432	327	0,02
	08/2023	TWD		24 150	791	16	0,00
	08/2023	\$	CLP	2 914	2 396 204	56	0,00
	08/2023		¥	628	83 400	(47)	0,00
	08/2023		NOK	2 462	25 677	(61)	0,00
	08/2023		ZAR	558	10 215	(20)	0,00
	09/2023	KRW	\$	204 470	158	2	0,00
	09/2023	\$	BRL	1 177	5 713	(6)	0,00
	09/2023		IDR	5	73 375	0	0,00
DUB	07/2023	PEN	\$	357	98	(1)	0,00
	07/2023	\$	BRL	9 827	53 244	1 212	0,08
	07/2023		PEN	196	715	0	0,00
	10/2023	ZAR	\$	8 696	478	22	0,00
GLM	07/2023	BRL		106 402	22 036	(21)	0,00
	07/2023	KRW		88 882	68	0	0,00
	08/2023	CHF		2 864	3 236	21	0,00
	08/2023	KRW		1 061 378	807	0	0,00
	08/2023	\$	INR	2 997	246 205	1	0,00
	08/2023		NOK	3 076	32 641	(25)	0,00
	09/2023	TWD	\$	35 334	1 161	24	0,00
	09/2023	\$	BRL	22 036	107 581	17	0,00
	09/2023		PEN	1 186	4 370	12	0,00
	10/2023	MXN	\$	5 411	308	(1)	0,00
MBC	10/2023	ZAR		9 925	530	10	0,00
	07/2023	¥		330 000	2 527	237	0,02
	08/2023	CNH		378	55	3	0,00
	08/2023	€		147 971	163 283	1 513	0,10
	08/2023	\$	CHF	742	663	2	0,00
	08/2023		€	1 343	1 225	(4)	0,00
	09/2023	¥	\$	1 863 000	13 571	546	0,04
MYI	09/2023	\$	KRW	2 320	2 959 169	(65)	(0,01)
	07/2023	€	\$	86	93	0	0,00
	07/2023	IDR		2 493 164	167	0	0,00
	07/2023	\$	£	547	433	4	0,00
	07/2023		IDR	166	2 493 164	0	0,00
	08/2023	TWD	\$	25 051	826	22	0,00
	08/2023	\$	€	779	719	7	0,00
	08/2023		¥	8 203	1 090 123	0	(0,04)
	08/2023	ZAR	\$	6 258	323	(7)	0,00
	09/2023	KRW		1 098 743	846	9	0,00
	09/2023	\$	IDR	539	8 059 149	(4)	0,00
RBC	09/2023		KRW	2 599	3 325 627	(64)	0,00
	07/2023		MXN	1	23	0	0,00
	08/2023	£	\$	38 516	48 665	0	(0,02)
	08/2023	\$	CHF	2 139	1 914	10	0,00
SCX	08/2023		MXN	880	15 242	2	0,00
	08/2023	CNH	\$	637	93	5	0,00
	08/2023	NZD		3 092	1 879	(15)	0,00
	08/2023	\$	NOK	1 161	12 340	(7)	0,00
	08/2023		NZD	526	843	(10)	0,00
	09/2023	KRW	\$	201 646	156	2	0,00
	09/2023	TWD		38 723	1 270	24	0,00
SSB	09/2023	\$	IDR	5 578	83 020 457	(63)	0,00
	07/2023	¥	\$	120 000	910	76	0,01
	07/2023	KRW		164 720	126	1	0,00
	07/2023	\$	BRL	10 516	52 821	0	0,00
	12/2023		INR	166	13 701	0	0,00
UAG	08/2023	£	\$	38 597	48 785	(296)	(0,02)
	08/2023	\$	CHF	790	712	9	0,00
	08/2023		£	7 881	6 228	39	0,00
	08/2023	ZAR	\$	33 736	1 757	(22)	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	
	09/2023	SGD	191	\$ 143	\$ 1	\$ 1	0,00	
	09/2023	ZAR	15 714	896	0	70	0,00	
					\$ 6 402	\$ (2 578)	\$ 3 824	0,26

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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, E en EUR (couverte) de distribution et Z 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	07/2023	€	18	\$ 20	\$ 0	\$ 0	0,00	
	07/2023	\$	248 660	€ 231 375	3 770	0	0,26	
BPS	07/2023	€	234 220	\$ 256 635	1 101	0	0,08	
	07/2023	\$	250 174	€ 232 693	3 693	0	0,25	
	08/2023		256 956	234 184	0	(1 111)	(0,08)	
CBK	07/2023	€	236 181	\$ 256 765	0	(909)	(0,06)	
	07/2023	\$	697	€ 641	3	(1)	0,00	
	08/2023		256 018	235 152	884	0	0,06	
MBC	07/2023	€	191	\$ 205	0	(4)	0,00	
	07/2023	\$	3 712	€ 3 455	59	(2)	0,01	
SCX	07/2023		249 465	233 109	4 857	0	0,33	
					\$ 14 367	\$ (2 027)	\$ 12 340	0,85

Au 30 juin 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	
BPS	07/2023	\$	105 036	£ 84 920	\$ 2 927	\$ 0	0,20	
BRC	07/2023		75 791	59 524	0	(115)	(0,01)	
CBK	07/2023	£	1 700	\$ 2 150	0	(11)	0,00	
	07/2023	\$	54	£ 43	0	0	0,00	
MBC	07/2023		105 325	85 082	2 844	0	0,20	
MYI	07/2023		104 636	84 189	2 398	0	0,16	
					\$ 8 169	\$ (126)	\$ 8 043	0,55

Au 30 juin 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	
BRC	07/2023	\$	3 561	SGD 4 819	\$ 0	\$ (1)	0,00	
GLM	07/2023	SGD	129	\$ 95	1	1	0,00	
	07/2023	\$	585	SGD 784	0	(5)	0,00	
MBC	07/2023		3 252	4 394	0	(5)	0,00	
	08/2023		4	5	0	0	0,00	
MYI	07/2023	SGD	5 215	\$ 3 860	6	6	0,00	
	08/2023	\$	3 860	SGD 5 210	0	(6)	0,00	
SCX	07/2023		387	523	0	0	0,00	
UAG	07/2023	SGD	9	\$ 7	0	0	0,00	
	07/2023	\$	4 396	SGD 5 936	0	(10)	0,00	
					\$ 7	\$ (27)	\$ (20)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 20 660 1,42

Total des Investissements

\$ 2 218 704 152,45

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (763 319) (52,45)

Actifs nets

\$ 1 455 385 100,00

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.

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

- (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
Intelsat Emergence S.A.	05/09/2018 - 23/02/2022	\$ 3 227	\$ 1 046	0,07
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25/09/2020	166	782	0,05
Westmoreland Mining Holdings LLC	26/03/2019	1	1	0,00
		\$ 3 394	1 829	0,12

Un montant en numéraire de 36 784 \$ (31 décembre 2022 : 28 338 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 4 353 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 480	\$ 1 699 324	\$ 8 224	\$ 1 708 028
Fonds d'investissement	145 966	0	0	145 966
Contrats de mise en pension	0	326 492	0	326 492
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	73	38 145	0	38 218
Totaux	\$ 146 519	\$ 2 063 961	\$ 8 224	\$ 2 218 704

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ (35)	\$ 0	\$ (35)
BOA	4 367	(3 450)	917	(2 834)	2 820	(14)
BPS	6 825	(5 480)	1 345	(1 952)	1 730	(222)
BRC	(394)	750	356	(307)	301	(6)
CBK	195	0	195	6 696	(6 666)	30
DUB	1 066	(1 170)	(104)	(582)	370	(212)
GLM	(1 123)	996	(127)	(2 097)	2 036	(61)
GST	(993)	1 154	161	(885)	904	19
HUS	1	0	1	1	0	1
MBC	5 124	(4 570)	554	4 371	(3 930)	441
MEI	(169)	280	111	(56)	260	204
MYC	(783)	1 173	390	(562)	813	251
MYI	1 751	(1 090)	661	(223)	270	47
RBC	(303)	0	(303)	(39)	0	(39)
SAL	S/O	S/O	S/O	(49)	0	(49)
SCX	4 793	(4 320)	473	6 363	(5 950)	413
SSB	511	(570)	(59)	16	0	16
UAG	(208)	0	(208)	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	50,04	35,07
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	67,31	75,51
Autres valeurs mobilières	0,01	1,33
Fonds d'investissement	10,03	9,79
Contrats de mise en pension	22,43	9,11
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,15	0,19
Instruments financiers dérivés compensés	1,06	0,57
Instruments financiers dérivés hors cote	1,42	0,66
Titres vendus à découvert	S/O	(0,48)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	2,27	6,41
Obligations et billets privés	14,95	26,11
Obligations et billets convertibles	0,04	0,05
Agences du gouvernement américain	53,28	33,41
Obligations du Trésor américain	10,20	9,02
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	21,96	19,47
Titres adossés à des actifs	7,78	8,93
Émissions souveraines	1,57	3,00
Actions ordinaires	0,17	0,29
Droits	0,00	0,01
Bons de souscription	0,00	0,00
Sociétés d'investissement immobilier	0,00	0,00
Instruments à court terme	5,14	5,21
Fonds d'investissement	10,03	9,79
Contrats de mise en pension	22,43	9,11
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,22	0,20
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,07)	(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	0,14	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,89	0,57
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,15	0,19
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,18)	(0,32)
Options à taux d'intérêt plafonné	(0,07)	(0,08)
Options sur titres	S/O	(0,01)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,02)	(0,04)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	(0,12)	(0,13)
Swaps de rendement total sur indices	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,26	(0,55)
Contrats de change à terme couverts	1,40	1,60
Titres vendus à découvert	S/O	(0,48)
Autres actifs et passifs à court terme	(52,45)	(31,75)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunites 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				INDUSTRIE			
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				VALEURS MOBILIÈRES				INDUSTRIE			
American Airlines, Inc. 10,000 % éch. 20/04/2028	\$ 1 100	\$ 1 125	0,10	Credit Suisse Group AG ^ 2,125 % éch. 19/11/2025	\$ 7 900	\$ 316	0,03	Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % éch. 05/02/2030	€ 2 400	\$ 2 226	0,20
IRB Holding Corp. 8,202 % éch. 15/12/2027	4 840	4 812	0,43	Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % éch. 19/11/2025	€ 2 000	1 883	0,17	3,650 % éch. 19/11/2029	1 400	1 298	0,12
MPH Acquisition Holdings LLC 9,726 % éch. 01/09/2028	3 832	3 435	0,31	CTP NV 0,625 % éch. 27/09/2026	2 700	2 382	0,21	Peugeot Invest 1,875 % éch. 30/10/2026	3 800	3 778	0,34
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % éch. 16/11/2025	1 215	1 128	0,10	1,500 % éch. 27/09/2031	2 500	1 904	0,17	Piper Sandler Cos. 5,200 % éch. 05/10/2023	\$ 1 600	1 596	0,14
		10 500	0,94	Deutsche Bank AG 1,625 % éch. 20/01/2027	2 000	1 940	0,17	Protective Life Global Funding 3,104 % éch. 15/04/2024	5 000	4 894	0,44
				2,625 % éch. 16/12/2024	€ 3 000	3 550	0,32	Rexford Industrial Realty LP 2,150 % éch. 01/09/2031	21	16	0,00
				3,729 % éch. 14/01/2032 (i)	\$ 2 200	1 665	0,15	Sagax AB 1,125 % éch. 30/01/2027	€ 1 700	1 565	0,14
				DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % éch. 25/01/2027	€ 2 100	1 740	0,16	Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % éch. 26/01/2028	600	497	0,04
				Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % éch. 29/04/2030	\$ 700	657	0,06	1,000 % éch. 17/05/2029	1 000	778	0,07
				Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % éch. 19/07/2024	€ 2 900	3 063	0,27	Santander Holdings USA, Inc. 3,244 % éch. 15/11/2024	\$ 100	90	0,01
				2,900 % éch. 16/02/2028	\$ 900	772	0,07	Santander UK Group Holdings PLC 3,625 % éch. 14/01/2026	€ 300	349	0,03
				3,021 % éch. 06/03/2024	€ 100	108	0,01	3,823 % éch. 03/11/2028	\$ 300	270	0,02
				3,250 % éch. 15/09/2025	€ 200	210	0,02	4,796 % éch. 15/11/2024	4 000	3 970	0,35
				3,375 % éch. 13/11/2025	\$ 600	558	0,05	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % éch. 22/06/2026	€ 1 100	992	0,09
				Goldman Sachs Group, Inc. 3,691 % éch. 05/06/2028	100	94	0,01	Sofina S.A. 1,000 % éch. 23/09/2028	2 500	2 184	0,19
				4,223 % éch. 01/05/2029	2 500	2 363	0,21	Standard Chartered PLC 1,214 % éch. 23/03/2025	\$ 1 500	1 443	0,13
				HSBC Holdings PLC 5,750 % éch. 20/12/2027	€ 100	121	0,01	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2,550 % éch. 10/03/2025	2 400	2 268	0,20
				6,000 % éch. 29/03/2040	200	223	0,02	3,629 % éch. 06/04/2026	€ 2 600	2 802	0,25
				6,254 % éch. 09/03/2034	\$ 2 100	2 154	0,19	Sun Communities Operating LP 4,200 % éch. 15/04/2032	\$ 2 500	2 186	0,20
				Huorong Finance Co. Ltd. 3,375 % éch. 24/02/2030	800	607	0,05	Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026	€ 8 000	8 716	0,78
				3,625 % éch. 30/09/2030	1 500	1 139	0,10	TP ICAP Finance PLC 2,625 % éch. 10/11/2028	€ 1 000	940	0,08
				4,250 % éch. 07/11/2027	200	167	0,01	5,250 % éch. 29/05/2026	1 400	1 640	0,15
				4,500 % éch. 29/05/2029	1 400	1 123	0,10	UBS AG 5,125 % éch. 15/05/2024 (h)	\$ 100	98	0,01
				4,750 % éch. 27/04/2027	1 000	866	0,08	UBS Group AG 1,000 % éch. 24/06/2027	€ 500	484	0,04
				ING Groep NV 1,728 % éch. 01/04/2027	3 000	2 674	0,24	2,125 % éch. 12/09/2025	€ 200	238	0,02
				Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % éch. 01/10/2027 (f)(h)	€ 1 700	1 796	0,16	2,125 % éch. 15/11/2029	2 400	2 387	0,21
				JPMorgan Chase & Co. 1,963 % éch. 23/03/2030	1 000	964	0,09	3,091 % éch. 14/05/2032	\$ 3 500	2 833	0,25
				Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % éch. 12/11/2025	2 900	2 808	0,25	3,750 % éch. 26/03/2025	150	144	0,01
				LeasePlan Corp. NV 2,875 % éch. 24/10/2024	\$ 1 200	1 144	0,10	4,194 % éch. 01/04/2031	800	712	0,06
				Legal & General Group PLC 5,625 % éch. 24/03/2031 (f)(h)	€ 600	590	0,05	4,650 % éch. 17/04/2026	1 000	962	0,09
				Lloyds Banking Group PLC 2,250 % éch. 16/10/2024	900	1 083	0,10	UniCredit SpA 7,500 % éch. 03/06/2026 (f)(h)	€ 1 200	1 289	0,12
				3,750 % éch. 11/01/2027	\$ 2 500	2 344	0,21	7,830 % éch. 04/12/2023	\$ 500	503	0,04
				3,750 % éch. 18/03/2028	1 000	924	0,08	VICI Properties LP 4,375 % éch. 15/05/2025	1 300	1 258	0,11
				4,375 % éch. 22/03/2028	400	380	0,03	Volkswagen Financial Services NV 1,625 % éch. 10/02/2024	€ 1 100	1 359	0,12
				4,716 % éch. 11/08/2026	3 000	2 916	0,26	1,875 % éch. 03/12/2024	2 000	2 378	0,21
				Logicor Financing SARL 0,625 % éch. 17/11/2025	€ 1 300	1 244	0,11	Wells Fargo & Co. 4,808 % éch. 25/07/2028	\$ 2 000	1 957	0,17
				1,500 % éch. 13/07/2026	1 000	943	0,08			190 893	17,02
				3,250 % éch. 13/11/2028	700	654	0,06				
				Midcap Financial Issuer Trust 5,625 % éch. 15/01/2030	\$ 200	159	0,01				
				Mitsubishi HC Capital, Inc. 3,960 % éch. 19/09/2023	1 600	1 592	0,14				
				Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,339 % éch. 19/07/2024	€ 1 600	1 679	0,15				
				5,242 % éch. 19/04/2029	\$ 600	591	0,05				
				Mizuho Financial Group, Inc. 3,477 % éch. 12/04/2026	3 050	2 889	0,26				
				NatWest Group PLC 2,000 % éch. 04/03/2025	€ 2 300	2 463	0,22				
				4,800 % éch. 05/04/2026	\$ 700	680	0,06				
				4,892 % éch. 18/05/2029	700	667	0,06				
				8,000 % éch. 10/08/2025 (f)(h)	300	292	0,03				
				NE Property BV 1,875 % éch. 09/10/2026	€ 1 500	1 421	0,13				
				2,000 % éch. 20/01/2030	3 100	2 503	0,22				
				Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,450 % éch. 15/09/2028	\$ 800	639	0,06				
				Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % éch. 27/01/2025	€ 2 200	2 322	0,21				

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
Brass PLC				NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
5,430 % éch. 16/11/2066	£ 1 336	\$ 1 703	0,15	6,500 % éch. 25/02/2035 ^	\$ 491	\$ 440	0,04	6,350 % éch. 15/01/2031	\$ 2 858	\$ 2 822	0,25
6,018 % éch. 16/11/2066	\$ 152	152	0,01	New Century Alternative Mortgage Loan Trust				Aurium CLO DAC			
Charter Mortgage Funding PLC				4,654 % éch. 25/10/2036	503	104	0,01	3,907 % éch. 16/01/2031	€ 4 693	5 022	0,45
5,327 % éch. 16/01/2057	£ 130	165	0,02	Newgate Funding PLC				4,618 % éch. 23/03/2032	5 000	5 373	0,48
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				4,126 % éch. 15/12/2050	€ 77	81	0,01	Bain Capital Euro CLO DAC			
6,780 % éch. 25/09/2035	\$ 4	4	0,00	5,165 % éch. 15/12/2050	£ 217	261	0,02	4,311 % éch. 24/01/2033	2 000	2 140	0,19
Countrywide Alternative Loan Trust				NovaStar Mortgage Funding Trust				Bayview Financial Acquisition Trust			
4,976 % éch. 25/12/2035	45	38	0,00	0,440 % éch. 25/09/2046	\$ 2 117	741	0,07	6,596 % éch. 28/12/2036	\$ 215	229	0,02
5,430 % éch. 25/04/2047	308	274	0,02	OBX Trust				BBVA Consumer Auto			
5,470 % éch. 25/09/2047	35	30	0,00	5,800 % éch. 25/06/2057	141	134	0,01	0,270 % éch. 20/07/2031	€ 499	531	0,05
5,500 % éch. 25/04/2035	1 004	708	0,06	Paragon Mortgages PLC				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
5,570 % éch. 25/07/2046	12	10	0,00	5,752 % éch. 15/05/2045	£ 278	354	0,03	5,368 % éch. 25/02/2036	\$ 1 182	1 178	0,11
5,750 % éch. 25/05/2036	72	31	0,00	Residential Accredit Loans, Inc. Trust				5,380 % éch. 25/02/2037	3 000	2 729	0,24
5,797 % éch. 20/12/2035	941	878	0,08	5,750 % éch. 25/06/2036 ^	\$ 20	16	0,00	6,005 % éch. 25/07/2034	1 359	1 309	0,12
6,000 % éch. 25/11/2036 ^	130	72	0,01	6,000 % éch. 25/04/2036	965	777	0,07	6,170 % éch. 25/10/2035	317	309	0,03
6,000 % éch. 25/07/2037	430	222	0,02	6,000 % éch. 25/06/2036 ^	138	110	0,01	6,200 % éch. 25/08/2037	814	683	0,06
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Residential Asset Securitization Trust				Black Diamond CLO DAC			
5,750 % éch. 25/12/2035 ^	12	6	0,00	6,500 % éch. 25/06/2037	2 901	714	0,06	4,303 % éch. 15/05/2032	€ 4 600	4 910	0,44
5,750 % éch. 25/02/2037 ^	492	236	0,02	RMAC Securities PLC				Blackrock European CLO DAC			
5,750 % éch. 25/08/2037	612	335	0,03	5,134 % éch. 12/06/2044	£ 43	53	0,00	3,797 % éch. 15/10/2031	5 400	5 756	0,51
6,000 % éch. 25/07/2036	266	144	0,01	Shamrock Residential DAC				Cairn CLO DAC			
6,500 % éch. 25/11/2036 ^	7	3	0,00	4,289 % éch. 24/12/2059	€ 2 160	2 334	0,21	3,912 % éch. 31/01/2030	597	641	0,06
Domi BV				4,289 % éch. 24/01/2061	3 309	3 572	0,32	4,051 % éch. 25/07/2029	43	47	0,00
4,376 % éch. 15/06/2051	€ 672	734	0,07	Silverstone Master Issuer PLC				4,212 % éch. 20/10/2028	12	13	0,00
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				5,249 % éch. 21/01/2070	£ 930	1 184	0,11	Carlyle Euro CLO DAC			
5,347 % éch. 19/10/2036	\$ 398	330	0,03	Stratton BTL Mortgage Funding PLC				3,953 % éch. 15/08/2030	2 626	2 801	0,25
Dutch Property Finance BV				5,221 % éch. 20/01/2054	9 251	11 701	1,04	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.			
3,892 % éch. 28/07/2054	€ 274	298	0,03	Stratton Mortgage Funding PLC				6,360 % éch. 15/10/2030	\$ 1 634	1 627	0,15
EMF-UK PLC				5,391 % éch. 20/07/2060	3 547	4 510	0,40	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.			
5,970 % éch. 13/03/2046	£ 39	49	0,00	5,792 % éch. 25/09/2051	8 277	10 498	0,94	4,073 % éch. 15/11/2031	€ 800	856	0,08
Eurohome UK Mortgages PLC				Structured Asset Mortgage Investments Trust				CBAM Ltd.			
5,137 % éch. 15/06/2044	80	98	0,01	5,370 % éch. 25/09/2047	\$ 676	564	0,05	6,500 % éch. 20/07/2030	\$ 2 144	2 136	0,19
European Loan Conduit DAC				Towd Point Mortgage Funding PLC				Cedar Funding CLO Ltd.			
4,358 % éch. 17/02/2030	€ 3 440	3 675	0,33	5,635 % éch. 20/10/2051	£ 3 547	4 517	0,40	6,230 % éch. 20/04/2031	1 100	1 088	0,10
Eurosaïl PLC				5,841 % éch. 20/07/2045	1 234	1 570	0,14	6,250 % éch. 20/01/2031	5 012	4 977	0,44
5,940 % éch. 13/06/2045	£ 245	307	0,03	6,216 % éch. 20/02/2045	233	296	0,03	CIFC Funding Ltd.			
Friary PLC				6,547 % éch. 20/02/2054	843	1 072	0,10	6,050 % éch. 20/01/2028	478	477	0,04
5,467 % éch. 21/11/2067	442	564	0,05	Trinidad Mortgage Securities PLC				6,262 % éch. 18/04/2031	700	694	0,06
Great Hall Mortgages PLC				5,443 % éch. 24/01/2059	23	29	0,00	CIT Mortgage Loan Trust			
5,166 % éch. 18/06/2039	61	77	0,01	Twin Bridges PLC				6,650 % éch. 25/10/2037	5 500	5 354	0,48
5,172 % éch. 18/06/2038	26	33	0,00	5,715 % éch. 12/03/2055	7 161	9 072	0,81	Citigroup Mortgage Loan Trust			
GSMPs Mortgage Loan Trust				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				5,210 % éch. 25/07/2045	385	267	0,02
5,500 % éch. 25/03/2035	\$ 90	79	0,01	3,753 % éch. 25/02/2037 ^	\$ 71	65	0,01	5,320 % éch. 25/07/2045	7 181	5 010	0,45
GSR Mortgage Loan Trust				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				5,450 % éch. 25/12/2036	99	40	0,00
6,000 % éch. 25/01/2037	1 202	756	0,07	5,750 % éch. 25/07/2036 ^	99	57	0,01	7,250 % éch. 25/05/2036	847	451	0,04
HarborView Mortgage Loan Trust				Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,537 % éch. 19/01/2038	36	34	0,00	5,615 % éch. 25/07/2034	9	9	0,00	6,095 % éch. 25/10/2034	48	46	0,00
5,567 % éch. 19/12/2036	3 933	3 287	0,29					Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
5,976 % éch. 19/10/2035	455	256	0,02					5,410 % éch. 25/03/2037	2 936	2 486	0,22
Harmony French Home Loans				TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				Contego CLO BV			
4,107 % éch. 27/05/2062	€ 6 132	6 719	0,60	Accredited Mortgage Loan Trust				3,947 % éch. 15/10/2030	€ 1 598	1 716	0,15
IndyMac Mortgage Loan Trust				5,410 % éch. 25/09/2036	487	479	0,04	Contego CLO DAC			
5,570 % éch. 25/07/2036	\$ 1 821	1 682	0,15	6,095 % éch. 25/09/2035	1 500	1 213	0,11	3,851 % éch. 23/01/2030	3 989	4 266	0,38
JPMorgan Alternative Loan Trust				Accunia European CLO DAC				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
5,510 % éch. 25/06/2037	4 090	2 231	0,20	4,127 % éch. 15/07/2030	€ 2 058	2 217	0,20	4,225 % éch. 25/05/2036	\$ 2 594	2 549	0,23
Jubilee Place BV				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				5,290 % éch. 25/06/2035	3 357	2 925	0,26
4,177 % éch. 17/10/2057	€ 1 551	1 692	0,15	5,430 % éch. 25/07/2036	\$ 98	73	0,01	5,330 % éch. 25/11/2047 ^	784	865	0,08
Landmark Mortgage Securities PLC				5,450 % éch. 25/07/2036	1 038	386	0,03	5,350 % éch. 25/06/2047 ^	2 839	2 456	0,22
4,865 % éch. 17/04/2044	£ 151	186	0,02	5,765 % éch. 25/12/2035	2 800	2 497	0,22	5,360 % éch. 25/05/2047 ^	74	64	0,01
Lehman XS Trust				Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,370 % éch. 25/09/2037 ^	365	366	0,03
5,550 % éch. 25/08/2046	\$ 182	167	0,02	5,855 % éch. 25/11/2035	1 106	1 077	0,10	5,810 % éch. 25/08/2035	318	308	0,03
5,600 % éch. 25/08/2046	362	351	0,03	6,020 % éch. 25/01/2036	3 400	3 168	0,28	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
Ludgate Funding PLC				6,170 % éch. 25/09/2034	1 112	1 079	0,10	3,044 % éch. 25/12/2036 ^	160	127	0,01
3,654 % éch. 01/12/2060	€ 19	20	0,00	Apidos CLO				6,065 % éch. 25/01/2034	471	452	0,04
5,068 % éch. 01/12/2060	£ 135	162	0,01	6,260 % éch. 20/04/2031	1 000	990	0,09	CVC Cordatus Loan Fund DAC			
Mansard Mortgages PLC				Ares European CLO DAC				3,855 % éch. 21/07/2030	€ 3 983	4 274	0,38
4,765 % éch. 15/04/2047	37	45	0,00	4,050 % éch. 20/04/2032	€ 2 500	2 676	0,24	3,937 % éch. 15/04/2032	3 416	3 664	0,33
5,651 % éch. 15/12/2049	131	163	0,01	Argent Securities Trust				4,103 % éch. 15/08/2032	5 471	5 856	0,52
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				5,370 % éch. 25/05/2036	\$ 165	41	0,00	Dryden Euro CLO DAC			
7,400 % éch. 25/11/2034	\$ 779	756	0,07	5,450 % éch. 25/07/2036	105	89	0,01	3,837 % éch. 15/04/2033	4 500	4 803	0,43
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				4,027 % éch. 15/07/2031	487	524	0,05
3,732 % éch. 25/12/2037	1 034	719	0,06	5,630 % éch. 25/05/2035	75	67	0,01	Elevation CLO Ltd.			
6,354 % éch. 25/08/2036 ^	10 607	2 122	0,19					6,478 % éch. 15/10/2029	\$ 1 174	1 174	0,10
Mortgage Equity Conversion Asset Trust								Ellington Loan Acquisition Trust			
5,790 % éch. 25/05/2042	360	336	0,03					6,250 % éch. 25/05/2037	3 172	3 038	0,27

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
Euro-Galaxy CLO DAC				5,370 % éch. 25/04/2037	\$ 583	\$ 416	0,04	Obligation internationale du gouvernement sud-africain			
3,765 % éch. 11/04/2031	€ 1 183	\$ 1 267	0,11	5,370 % éch. 25/05/2037	643	380	0,03	4,850 % éch. 30/09/2029	\$ 2 000	\$ 1 763	0,16
Fieldstone Mortgage Investment Trust				OZLM Ltd.				Obligation internationale du gouvernement turc			
5,818 % éch. 25/04/2047	\$ 1 993	1 407	0,13	6,280 % éch. 15/04/2031	2 400	2 364	0,21	5,750 % éch. 22/03/2024	1 000	985	0,09
Fremont Home Loan Trust				6,340 % éch. 17/04/2031	985	972	0,09	6,350 % éch. 10/08/2024	2 500	2 462	0,22
5,285 % éch. 25/10/2036	148	131	0,01	6,400 % éch. 20/01/2031	1 717	1 700	0,15			12 007	1,07
5,350 % éch. 25/08/2036	211	71	0,01	OZLME DAC							
6,020 % éch. 25/05/2034	1 325	1 225	0,11	4,088 % éch. 27/07/2032	€ 2 198	2 339	0,21				
GE-WMC Mortgage Securities Trust				Palmer Square European Loan Funding DAC							
5,450 % éch. 25/08/2036	5 159	2 258	0,20	5,025 % éch. 12/04/2032	4 774	5 237	0,47				
Greenwood Park CLO Ltd.				Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust							
6,290 % éch. 15/04/2031	1 250	1 240	0,11	5,645 % éch. 25/07/2036	\$ 638	597	0,05				
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				RAAC Trust							
6,373 % éch. 15/09/2037	2 253	2 223	0,20	5,910 % éch. 25/10/2046	94	89	0,01				
GSAA Home Equity Trust				Residential Asset Securities Corp. Trust							
5,772 % éch. 25/11/2036 ^	468	144	0,01	5,490 % éch. 25/11/2036	44	41	0,00				
5,985 % éch. 25/06/2036	1 350	373	0,03	5,735 % éch. 25/03/2036	965	951	0,08				
GSAMP Trust				Sculptor European CLO DAC							
5,290 % éch. 25/11/2036	1 900	905	0,08	3,916 % éch. 14/01/2032	€ 5 000	5 359	0,48				
5,670 % éch. 25/02/2046	531	488	0,04	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust							
HSI Asset Securitization Corp. Trust				5,470 % éch. 25/10/2036	\$ 9 702	3 377	0,30				
5,930 % éch. 25/01/2036	2 200	1 722	0,15	5,810 % éch. 25/08/2035 ^	55	43	0,00				
ICG U.S. CLO Ltd.				Segovia European CLO DAC							
6,353 % éch. 22/07/2031	5 200	5 141	0,46	4,080 % éch. 20/07/2032	€ 6 900	7 335	0,65				
Jubilee CLO DAC				SG Mortgage Securities Trust							
4,326 % éch. 15/12/2029	€ 1 160	1 251	0,11	5,360 % éch. 25/10/2036	\$ 3 600	2 493	0,22				
LCM LP				Sierra Madre Funding Ltd.							
6,290 % éch. 20/10/2027	\$ 126	126	0,01	5,571 % éch. 07/09/2039	2 087	1 495	0,13				
Lehman XS Trust				Sound Point CLO Ltd.							
6,119 % éch. 25/03/2037	1 901	1 877	0,17	6,368 % éch. 26/07/2031	1 000	983	0,09				
LoanCore Issuer Ltd.				6,412 % éch. 18/04/2031	7 400	7 271	0,65				
6,616 % éch. 17/01/2037	500	492	0,04	Soundview Home Loan Trust							
Long Beach Mortgage Loan Trust				5,350 % éch. 25/06/2037	2 237	1 529	0,14				
5,590 % éch. 25/02/2036	340	329	0,03	5,410 % éch. 25/02/2037	1 004	291	0,03				
6,065 % éch. 25/08/2035	4 270	3 769	0,34	5,650 % éch. 25/10/2036	1 395	1 302	0,12				
Madison Park Funding Ltd.				Structured Asset Investment Loan Trust							
6,103 % éch. 22/04/2027	546	543	0,05	6,125 % éch. 25/01/2035	1 685	1 507	0,13				
Man GLG Euro CLO DAC				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust							
3,857 % éch. 15/10/2030	€ 2 198	2 355	0,21	5,305 % éch. 25/09/2036	4 731	2 975	0,27				
4,023 % éch. 15/05/2031	499	535	0,05	6,670 % éch. 25/04/2035	27	27	0,00				
4,047 % éch. 15/01/2030	440	474	0,04	Toro European CLO DAC							
Midocean Credit CLO				4,097 % éch. 15/07/2030	€ 223	241	0,02				
6,385 % éch. 19/07/2028	\$ 104	104	0,01	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust							
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				5,375 % éch. 25/05/2037	\$ 485	445	0,04				
5,220 % éch. 25/10/2036	1 420	617	0,06	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust							
5,280 % éch. 25/11/2036	1 660	754	0,07	5,750 % éch. 25/04/2037	4 701	3 241	0,29				
5,290 % éch. 25/05/2037	1 361	1 184	0,11	6,875 % éch. 25/11/2035	100	98	0,01				
5,380 % éch. 25/10/2036	1 152	610	0,05			220 863	19,70				
5,380 % éch. 25/11/2036	5 128	2 828	0,25								
5,400 % éch. 25/07/2036	426	367	0,03								
5,450 % éch. 25/09/2036	15 068	5 672	0,51								
5,650 % éch. 25/04/2036	99	92	0,01								
5,690 % éch. 25/12/2034	1 362	1 194	0,11								
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust											
5,660 % éch. 25/02/2036	1 800	1 624	0,14								
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust											
6,226 % éch. 25/10/2036 ^	272	84	0,01								
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust											
5,950 % éch. 25/02/2037 ^	3 172	945	0,08								
Novastar Mortgage Funding Trust											
5,310 % éch. 25/09/2037	17	16	0,00								
5,470 % éch. 25/05/2036	44	43	0,00								
Oak Hill European Credit Partners DAC											
3,930 % éch. 20/01/2032	€ 669	718	0,06								
Option One Mortgage Loan Trust											
5,290 % éch. 25/01/2037	\$ 51	29	0,00								
5,290 % éch. 25/02/2037	614	404	0,04								
5,290 % éch. 25/03/2037	728	653	0,06								

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	5,120 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 87 900	Billets du Trésor américain 3,500 % échéance 31/01/2028	\$ (89 679)	\$ 87 900	\$ 87 938	7,84
	5,160	30/06/2023	03/07/2023	4 300	Billets du Trésor américain 2,000 % échéance 15/08/2025	(4 392)	4 300	4 302	0,38

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

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
	5,180 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 100	Billets du Trésor américain 0,375 % échéance 30/04/2025	\$ (102)	\$ 100	\$ 100	0,01
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	2 587	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	(2 639)	2 587	2 587	0,23
Total des Contrats de mise en pension						\$ (96 812)	\$ 94 887	\$ 94 927	8,46

⁽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 septembre	Court	09/2023	297	\$ 541	0,05
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	165	234	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Long	09/2023	12	27	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Court	09/2023	435	426	0,04
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	445	(1 217)	(0,11)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	531	1 084	0,10
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	1 433	2 576	0,23
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	522	393	0,03
				\$ 4 064	0,36

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	\$ 98,000	15/12/2023	133	\$ 0	\$ (7)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	133	0	(626)	(0,05)
				\$ 0	\$ (633)	(0,05)

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 3 431 0,31

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	\$ 3 200	\$ 16	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	1 700	(19)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	200	1	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	500	23	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	1 700	8	0,00
				\$ 29	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.HY-34 à 5 ans	(5,000) %	20/06/2025	\$ 20 700	\$ (1 972)	(0,17)
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	(5,000)	20/12/2027	10 989	(517)	(0,05)
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	(5,000)	20/06/2028	15 000	(350)	(0,03)
				\$ (2 839)	(0,25)

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 à 5 ans	1,000 %	20/06/2028	\$ 1 600	\$ 12	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	3,500 %	20/09/2033	£ 29 800	\$ (1 475)	(0,13)
À recevoir ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	27 500	1 778	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 recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000 %	04/08/2023	\$ 335 700	\$ 4 631	0,41
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	17/09/2023	5 000	(68)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2026	16 480	(1 277)	(0,11)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	17/06/2030	5 000	697	0,06
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,270	04/11/2023	335 700	(6 658)	(0,59)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	21/12/2052	34 600	2 571	0,23
À payer ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,827	03/07/2028	73 000	(6 790)	(0,61)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,853	18/05/2032	37 780	(4 768)	(0,43)
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,999	03/07/2053	14 900	3 317	0,30
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	12/02/2030	9 900	1 280	0,11
À recevoir ⁽⁴⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	10/03/2030	4 900	541	0,05
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	13 000	33	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,080	23/02/2053	1 000	(18)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,370	01/03/2033	1 400	(24)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,400	23/02/2033	2 800	(41)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,405	01/03/2033	1 400	(20)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,425	01/03/2033	1 400	(18)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,430	27/02/2033	1 900	(24)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,450	07/03/2033	1 500	(16)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	4 900	(82)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	2 600	(21)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,055	04/01/2027	BRL 18 600	23	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,086	04/01/2027	114 100	139	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,098	04/01/2027	76 900	99	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,734	02/01/2025	24 800	(3)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,800	02/01/2025	111 000	14	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,814	04/01/2027	69 000	404	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	11,835	02/01/2025	111 000	29	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,868	04/01/2027	14 300	88	0,01
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,000	14/11/2023	CAD 44 700	(549)	(0,05)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,060	28/10/2023	139 400	(1 735)	(0,16)
À payer	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	4,000	21/06/2025	111 800	(813)	(0,07)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	01/11/2023	NZD 120 200	(1 031)	(0,09)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	15/12/2023	139 900	(1 155)	(0,10)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/08/2023	\$ 335 700	(4 605)	(0,41)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	17/09/2023	5 000	69	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/09/2023	16 480	(216)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	12/08/2023	9 900	39	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	10/09/2023	4 900	20	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	€ 11 000	(164)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	11 300	(169)	(0,02)
À recevoir ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	18 300	(60)	(0,01)
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	6 000	53	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,985	11/10/2027	PLN 69 300	(1 821)	(0,16)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,015	11/10/2027	64 100	(1 705)	(0,15)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,156	13/10/2027	42 800	(1 206)	(0,11)
					\$ (20 707)	(1,85)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (23 505)	(2,10)

(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) 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.

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities 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

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 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021 %	25/10/2023	6 200	\$ 354	\$ 1 572	0,14
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021	15/09/2023	10 500	551	2 529	0,23
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021	15/09/2023	11 000	598	2 739	0,24
							\$ 1 503	\$ 6 840	0,61

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 de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020 %	25/10/2023	31 000	\$ (355)	\$ (2 790)	(0,25)
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	15/09/2023	52 500	(551)	(4 876)	(0,43)
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	4 600	(30)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	4 600	(30)	(93)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	4 600	(32)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	4 600	(32)	(88)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	4 600	(32)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	4 600	(32)	(86)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	4 600	(32)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	4 600	(32)	(85)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	4 600	(32)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	4 600	(32)	(95)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	4 700	(32)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	4 700	(32)	(102)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	24 600	(89)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	24 600	(89)	(320)	(0,03)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	36 100	(126)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	36 100	(126)	(500)	(0,04)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	13 300	(41)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	13 300	(42)	(166)	(0,01)
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	15/09/2023	55 000	(598)	(5 183)	(0,46)
							\$ (2 397)	\$ (14 397)	(1,28)

⁽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
BOA	UBS AG	(1,000) %	20/06/2024	\$ 200	\$ 13	\$ (13)	\$ 0	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 ⁽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)	\$ 22	\$ (4)	0,00
GLM	Petrobras Global Finance BV	1,000	20/12/2023	1 200	(88)	92	4	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	200	(3)	5	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	2 300	(102)	102	0	0,00
					\$ (219)	\$ 221	\$ 2	0,00

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

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)	\$ 0	\$ (9)	0,00
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	100	(4)	3	(1)	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	1 500	(3)	(3)	(6)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	300	(9)	8	(1)	0,00
					\$ (25)	\$ 8	\$ (17)	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.

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	07/2023	AUD	1 039	\$ 689	\$ 0	\$ (2)	0,00	
	07/2023	\$	459	AUD 702	8	0	0,00	
	08/2023		690	1 039	2	0	0,00	
BOA	07/2023	¥	800	\$ 6	0	0	0,00	
	07/2023	MXN	62 112	3 374	0	(239)	(0,02)	
	07/2023	PLN	9 887	2 400	0	(32)	0,00	
	07/2023	\$	1 564	AUD 2 401	34	0	34	0,00
	07/2023		1 129	£ 893	6	0	6	0,00
	07/2023		519	PLN 2 173	16	0	16	0,00
	08/2023	CNY	287	\$ 42	2	0	2	0,00
	08/2023	NZD	356	226	8	0	8	0,00
	08/2023	\$	749	BRL 3 647	4	0	4	0,00
	08/2023	ZAR	97	\$ 5	0	0	0	0,00
	09/2023	TWD	886	29	1	0	1	0,00
BPS	07/2023	AUD	743	492	0	(2)	0,00	
	07/2023	€	220 055	236 596	2	(3 485)	(0,31)	
	07/2023	PEN	6 822	1 865	0	(17)	0,00	
	07/2023	PLN	22 175	5 165	0	(288)	(0,02)	
	07/2023	\$	238 529	€ 217 701	2	(1 019)	(0,09)	
	07/2023		1 339	£ 1 054	1	0	1	0,00
	07/2023		14 447	¥ 2 008 078	0	(553)	(0,05)	
	07/2023		3 742	PEN 13 643	21	0	21	0,00
	08/2023	CNH	2 053	\$ 297	14	0	14	0,00
	08/2023	CNY	151	22	1	0	1	0,00
	08/2023	€	216 580	237 640	1 028	0	1 028	0,09
	08/2023	TWD	443	15	0	0	0	0,00
	08/2023	\$	492	AUD 743	2	0	2	0,00
	08/2023		44	CNH 307	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023		889	ZAR 16 553	0	(17)	(17)	0,00
	09/2023		42	PEN 153	0	0	0	0,00
	09/2023		0	THB 5	0	0	0	0,00
BRC	07/2023	MYR	27	\$ 6	0	0	0,00	
	07/2023	PLN	1 430	342	0	(9)	0,00	
	07/2023	\$	1 079	£ 867	23	0	23	0,00
	08/2023		2 409	COP 10 264 091	19	0	19	0,00
08/2023		1 061	HUF 364 628	0	(7)	(7)	0,00	
08/2023		1 084	ZAR 20 028	0	(28)	(28)	0,00	
10/2023	MXN	112 225	\$ 5 990	0	(428)	(0,04)		
CBK	07/2023	CAD	1 784	1 309	0	(39)	0,00	
	07/2023	CLP	5 783 983	7 147	0	(56)	(0,01)	
	07/2023	PEN	6 822	1 878	0	(3)	0,00	
	07/2023	\$	1 086	€ 1 004	9	0	9	0,00
	07/2023		2 286	PEN 8 474	51	0	51	0,01
	07/2023		4	PHP 225	0	0	0	0,00
	08/2023	CNY	14	\$ 2	0	0	0	0,00
	08/2023	TWD	427	14	0	0	0	0,00
	08/2023	\$	7 154	CLP 5 853 517	91	0	91	0,01
	08/2023		1 343	PEN 5 246	99	0	99	0,01
	09/2023	IDR	88 939	\$ 6	0	0	0	0,00
GLM	07/2023	BRL	53 329	11 045	0	(10)	0,00	
	07/2023	\$	9 869	BRL 53 160	1 149	0	1 149	0,10
	07/2023		1 775	PLN 7 517	73	0	73	0,01
	08/2023	BRL	10 431	\$ 2 040	0	(112)	(0,01)	
	09/2023	PEN	25 621	6 954	0	(72)	(0,01)	
	09/2023	\$	11 045	BRL 53 920	9	0	9	0,00
MBC	10/2023		2 530	MXN 44 410	10	0	10	0,00
	07/2023	CAD	987	\$ 740	0	(6)	0,00	
	07/2023	€	741	793	0	(16)	0,00	
	07/2023	£	66 391	82 183	0	(2 223)	(0,20)	
	07/2023	PLN	57 869	13 366	0	(866)	(0,08)	
MYI	07/2023	\$	550	€ 514	10	0	10	0,00
	08/2023	HUF	310 241	\$ 909	13	0	13	0,00
	08/2023	\$	638	CNH 4 382	0	(34)	(34)	0,00
	07/2023	PLN	1 262	\$ 310	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$	204	€ 187	0	0	0	0,00
	07/2023		1 258	£ 997	9	0	9	0,00
	07/2023		1 233	¥ 178 000	0	(2)	(2)	0,00
RBC	07/2023		1 065	PLN 4 465	33	0	33	0,00
	08/2023	TWD	477	\$ 16	0	0	0	0,00
	08/2023	\$	6	TWD 183	0	0	0	0,00
	09/2023	THB	13 411	\$ 392	11	0	11	0,00
	07/2023	\$	3	MXN 55	0	0	0	0,00
SCX	08/2023		7 469	129 443	17	0	17	0,00
	07/2023	AUD	1 526	\$ 1 013	0	(3)	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
	07/2023	\$	1 346	AUD	2 060	\$ 25	0,00
	08/2023	CNH	2 418	\$	351	18	0,00
	08/2023	NZD	126		79	2	0,00
	08/2023	\$	1 014	AUD	1 526	3	0,00
	09/2023	THB	9 533	\$	276	5	0,00
	09/2023	TWD	740		24	1	0,00
	09/2023	\$	147	PEN	541	2	0,00
SSB	07/2023	PEN	7 397	\$	2 028	0	0,00
	07/2023	\$	7 211	CLP	5 792 275	2	0,00
	08/2023	CLP	5 809 004	\$	7 211	1	0,00
	08/2023	\$	2 025	PEN	7 397	10	0,00
	09/2023	BRL	3 661	\$	722	0	0,00
TOR	07/2023	AUD	1 878		1 240	0	0,00
	07/2023	\$	1 605	AUD	2 454	29	0,00
	07/2023		2 094	CAD	2 771	2	0,00
	07/2023		82 127	£	64 631	42	0,01
	08/2023	CAD	2 770	\$	2 094	1	0,00
	08/2023	£	64 631		82 145	0	0,00
	08/2023	\$	1 241	AUD	1 878	10	0,00
UAG	07/2023	AUD	2 993	\$	1 999	10	0,00
	07/2023	\$	368	AUD	562	6	0,00
	08/2023		2 000		2 993	4	0,00
	08/2023	ZAR	33 701	\$	1 755	1	0,00
						\$ 2 952	
						\$ (9 701)	
						\$ (6 749)	
							(0,60)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$	12 204	€	11 353	\$ 182	0,02
BPS	07/2023	€	11 365	\$	12 453	54	0,00
	07/2023	\$	12 085	€	11 241	179	0,02
	08/2023		12 449		11 346	0	(0,01)
CBK	07/2023	€	9 565	\$	10 398	0	0,00
	07/2023	\$	269	€	248	1	0,00
	08/2023		10 291		9 452	36	0,00
MBC	07/2023	€	91	\$	98	0	0,00
	07/2023	\$	119	€	110	2	0,00
MYI	07/2023	€	5 661	\$	6 182	5	0,00
SCX	07/2023	\$	12 026	€	11 238	234	0,02
						\$ 693	
						\$ (94)	
						\$ 599	
							0,05

Au 30 juin 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	07/2023	£	212	\$	269	\$ 0	0,00
BPS	07/2023		1 480		1 894	14	0,00
	07/2023	\$	270 851	£	218 978	7 547	0,67
BRC	07/2023	£	507	\$	635	0	0,00
CBK	07/2023		968		1 227	1	0,00
	07/2023	\$	5	£	4	0	0,00
MBC	07/2023	£	73	\$	94	1	0,00
	07/2023	\$	270 330	£	218 380	7 307	0,65
MYI	07/2023		270 897		217 962	6 209	0,56
TOR	07/2023	£	218 130	\$	277 177	0	(0,01)
	08/2023	\$	277 238	£	218 130	137	0,01
UAG	07/2023		95 805		75 739	486	0,04
						\$ 21 702	
						\$ (158)	
						\$ 21 544	
							1,92

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 7 822 0,70

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. 01/08/2053			
	\$ 55 800	\$ (45 584)	(4,07)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (45 584)	(4,07)
Total des Investissements		\$ 1 200 912	107,09
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (79 535)	(7,09)
Actifs nets		\$ 1 121 377	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
Deutsche Bank AG 3,729 % échéance 14/01/2032	11/01/2021 - 24/02/2021	2 202	1 665	0,15
		\$ 2 269	\$ 1 732	0,16

Un montant en numéraire de 29 215 \$ (31 décembre 2022 : 29 843 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 6 884 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 1 054 967	\$ 368	\$ 1 055 335
Fonds d'investissement	108 526	0	0	108 526
Contrats de mise en pension	0	94 887	0	94 887
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	1 228	(13 480)	0	(12 252)
Titres vendus à découvert	0	(45 584)	0	(45 584)
Totaux	\$ 109 754	\$ 1 090 790	\$ 368	\$ 1 200 912

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 8	\$ 0	\$ 8	\$ S/O	\$ S/O	\$ S/O
BOA	(1 237)	1 040	(197)	(3 452)	3 430	(22)
BPS	3 426	(1 500)	1 926	(3 383)	3 100	(283)
BRC	(443)	270	(173)	(105)	30	(75)
CBK	148	0	148	287	(540)	(253)
CLY	S/O	S/O	S/O	(20)	0	(20)
FAR	(2 347)	2 270	(77)	(1 707)	1 460	(247)
GLM	(497)	580	83	(15 394)	15 157	(237)

Contrepartie	Au 30 juin 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⁾
GST	\$ (7)	\$ 0	\$ (7)	\$ (12)	\$ 22	\$ 10
MBC	4 186	(3 050)	1 136	(1 943)	1 280	(663)
MYC	(2 445)	2 370	(75)	(1 783)	1 490	(293)
MYI	6 264	(4 190)	2 074	510	(320)	190
RBC	17	0	17	(28)	0	(28)
RYL	S/O	S/O	S/O	(25)	0	(25)
SAL	(6)	94	88	(102)	94	(8)
SCX	287	(280)	7	354	(460)	(106)
SSB	(27)	260	233	(2 629)	1 900	(729)
TOR	25	(20)	5	191	(750)	(559)
UAG	470	0	470	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	57,79	44,59
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	36,29	43,14
Autres valeurs mobilières	0,03	2,68
Fonds d'investissement	9,68	9,89
Contrats de mise en pension	8,46	8,83
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,31	0,66
Instruments financiers dérivés compensés	(2,10)	(2,52)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,70	(2,17)
Titres vendus à découvert	(4,07)	(6,99)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,94	2,57
Obligations et billets privés	25,58	23,54
Obligations et billets municipaux	0,69	0,56
Agences du gouvernement américain	18,71	14,02
Obligations du Trésor américain	17,36	14,38
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	8,52	7,79
Titres adossés à des actifs	19,70	17,36
Émissions souveraines	1,07	2,15
Actions ordinaires	0,01	0,01
Titres privilégiés	0,01	0,03
Instruments à court terme	1,52	8,00
Fonds d'investissement	9,68	9,89
Contrats de mise en pension	8,46	8,83
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,36	0,69
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,05)	(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 - achat de protection	(0,25)	(0,15)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(1,85)	(2,37)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,61	0,75
Options vendues	S/O	0,00
Swaptions de défaillance sur indices de crédit		
Swaptions de taux d'intérêt	(1,28)	(2,34)
Options sur titres	S/O	(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	0,00	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	(0,60)	(0,77)
Contrats de change à terme couverts	1,97	0,12
Titres vendus à découvert	(4,07)	(6,99)
Autres actifs et passifs à court terme	(7,09)	1,89
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities ESG 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 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	3,500 %	20/09/2033	£ 150	\$ (8)	(0,18)
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	100	6	0,12
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,060	28/10/2023	CAD 600	0	0,00
À payer	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	4,000	21/06/2025	500	(4)	(0,07)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	€ 100	0	0,01
					\$ (6)	(0,12)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (6)	(0,12)

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	08/2023	\$ 14	AUD 21	\$ 0	\$ 0	\$ 0	(0,01)
	08/2023	3	€ 3	0	0	0	0,00
BRC	08/2023	£ 13	\$ 16	0	0	0	(0,01)
	08/2023	\$ 15	¥ 1 938	0	(1)	(1)	(0,02)
CBK	08/2023	CAD 14	\$ 10	0	0	0	0,00
	08/2023	€ 3	3	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 2	¥ 319	0	0	0	0,00
GLM	08/2023	CAD 4	\$ 3	0	0	0	0,00
MBC	08/2023	€ 620	684	6	0	6	0,14
MY1	08/2023	\$ 31	¥ 4 165	0	(3)	(3)	(0,05)
RYL	08/2023	£ 2	\$ 3	0	0	0	0,00
UAG	08/2023	7	9	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ (4)	\$ 2	0,05

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$ 84	€ 78	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,03
CBK	07/2023	€ 79	\$ 86	0	0	0	(0,01)
	08/2023	\$ 85	€ 78	0	0	0	0,01
MBC	07/2023	84	79	2	0	2	0,03
SCX	07/2023	84	79	2	0	2	0,03
				\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,09

Au 30 juin 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
MBC	07/2023	\$ 84	£ 68	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,05
MY1	07/2023	84	68	2	0	2	0,04
UAG	07/2023	86	69	2	0	2	0,03
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,12

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 13 0,26

Total des Investissements

\$ 5 392 107,47

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (375) (7,47)

Actifs nets

\$ 5 017 100,00

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.

Un montant en numéraire de 50 \$ (31 décembre 2022 : 31 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 5 400	\$ 0	\$ 5 400
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	5	(13)	0	(8)
Totaux	\$ 5	\$ 5 387	\$ 0	\$ 5 392

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	(1)	0	(1)	(8)	0	(8)
CBK	S/O	S/O	S/O	(8)	0	(8)
GLM	S/O	S/O	S/O	2	0	2
MBC	10	0	10	S/O	S/O	S/O
MYI	(1)	0	(1)	(11)	0	(11)
SCX	2	0	2	(16)	0	(16)
UAG	2	0	2	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	88,08	32,23
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	19,55	70,65
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,30)	(0,18)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,12)	0,02
Instruments financiers dérivés hors cote	0,26	(0,75)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,40	1,53
Obligations et billets privés	38,47	34,48
Agences du gouvernement américain	13,14	5,49
Titres adossés à des actifs	2,13	2,12
Instruments à court terme	53,49	59,26
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,30)	(0,18)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de taux d'intérêt	(0,12)	0,02
Instruments financiers dérivés hors cote		
Contrats de change à terme	0,05	(0,87)
Contrats de change à terme couverts	0,21	0,12
Autres actifs et passifs à court terme	(7,47)	(1,97)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

DESCRIPTION	JUSTE EN % DE			DESCRIPTION	JUSTE EN % DE			DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET				
	ACTIONS	VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET		ACTIONS	VALEUR (en milliers)	L'ACTIF NET								
VALEURS MOBILIÈRES															
CANADA															
ACTIONS ORDINAIRES															
Enbridge, Inc.	29 800	\$ 1 109	1,14	Equitrans Midstream Corp.	105 200	\$ 1 006	1,04	BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN							
Pembina Pipeline Corp.	75 700	2 383	2,45	Hess Midstream LP « A »	22 700	696	0,72	5,156 % éch. 03/08/2023 (a)(b)	\$ 1 800	\$ 1 792	1,85				
TC Energy Corp.	29 720	1 202	1,24	Kinder Morgan, Inc.	125 600	2 163	2,23	5,177 % éch. 15/08/2023 (a)(b)	28 400	28 225	29,07				
Total Canada	4 694	4,83		Marathon Oil Corp.	58 500	1 347	1,39	5,239 % éch. 07/09/2023 (a)(b)	1 800	1 783	1,84				
ÉTATS-UNIS															
ACTIONS ORDINAIRES															
ÉNERGIE															
Antero Midstream Corp.	107 900	1 252	1,29	Occidental Petroleum Corp.	26 066	1 533	1,58	5,242 % éch. 20/07/2023 (a)(b)	3 100	3 093	3,18				
Cheniere Energy, Inc.	31 133	4 743	4,88	ONEOK, Inc.	55 730	3 440	3,54	Total des Instruments à court terme		34 893	35,94				
Chesapeake Energy Corp.	34 400	2 879	2,96	Pioneer Natural Resources Co.	11 200	2 320	2,39	Total des Valeurs mobilières	\$	86 230	88,81				
ConocoPhillips	16 700	1 730	1,78	Targa Resources Corp.	67 700	5 152	5,31	ACTIONS							
Devon Energy Corp.	30 200	1 460	1,50	Williams Cos., Inc.	148 100	4 832	4,98	FONDS D'INVESTISSEMENT							
DTE Midstream LLC	84 900	4 208	4,33	Total États-Unis	\$	44 643	45,98	ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF							
EnLink Midstream LLC	225 400	2 389	2,46	INSTRUMENTS À COURT TERME											
EOG Resources, Inc.	8 700	996	1,03	BILLETTS À COURT TERME											
EQT Corp.	60 700	2 497	2,57	Federal Home Loan Bank											
				5,100 % éch. 25/08/2023											
					\$	2 000	2,00	939 277		9 353	9,63				
								Total des Fonds d'investissement	\$	9 353	9,63				

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 840	Billets du Trésor américain	\$ (857)	\$ 840	\$ 840	0,87
Total des Contrats de mise en pension									
						\$ (857)	\$ 840	\$ 840	0,87

(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
BPS	À recevoir	Indice AMZX Index	1 179	Taux LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	\$ 1 851	11/10/2023	\$ 0	\$ 69	\$ 69	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	241 320	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	\$ 3 074	11/10/2023	\$ 0	\$ (9)	\$ (9)	(0,01)
	À recevoir	MPLX LP	212 600	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	7 088	15/11/2023	0	96	96	0,10
	À recevoir	Plains All American Pipeline LP	186 056	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	2 404	15/11/2023	0	209	209	0,22
	À recevoir	Sunoco LP	60 200	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	2 588	15/11/2023	0	23	23	0,03
	À recevoir	Energy Transfer LP	242 369	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	3 005	17/01/2024	0	59	59	0,06
CBK	À recevoir	Enterprise Products Partners LP	260 070	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	6 588	17/01/2024	0	236	236	0,24
	À recevoir	Western Midstream Partners LP	121 461	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	3 066	17/01/2024	0	142	142	0,15
	À recevoir	Energy Transfer LP	205 784	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	2 622	11/10/2023	0	(9)	(9)	(0,01)
FAR	À recevoir	Crestwood Equity Partners LP	56 900	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	1 460	06/09/2023	0	46	46	0,05
	À recevoir	Crestwood Equity Partners LP	41 700	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	1 070	06/09/2023	0	30	30	0,03
JPM	À recevoir	Crestwood Equity Partners LP	13 000	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	334	06/09/2023	0	9	9	0,01
MYI	À recevoir	Enterprise Products Partners LP	25 000	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	656	11/10/2023	0	3	3	0,00
	À recevoir	Western Midstream Partners LP	77 089	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	2 032	11/10/2023	0	12	12	0,01
	À recevoir	Western Midstream Partners LP	68 832	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	1 737	15/11/2023	0	80	80	0,08

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(recues)	Plus-value/(moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
	À recevoir	Plains All American Pipeline LP	426 400	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	\$ 5 509	17/01/2024	\$ 0	\$ 478	\$ 478	0,49
							\$ 0	\$ 1 405	\$ 1 405	1,45

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	07/2023	CAD	8 737	\$ 6 421	\$ 0	\$ (182)	(0,19)	
BPS	08/2023	\$	163	€ 149	0	0	0,00	
BRC	08/2023	€	110	\$ 120	0	0	0,00	
MBC	07/2023	\$	1 467	CAD 1 977	27	0	0,03	
	07/2023		110	£ 89	3	0	0,00	
MYI	07/2023		49	€ 45	0	0	0,00	
TOR	07/2023	£	89	\$ 113	0	0	0,00	
	07/2023	\$	5 109	CAD 6 760	4	(4)	0,00	
	08/2023	CAD	6 758	\$ 5 109	4	(4)	0,00	
	08/2023	\$	113	£ 89	0	0	0,00	
					\$ 38	\$ (190)	(152)	(0,16)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	
BOA	07/2023	€	995	\$ 1 076	\$ 0	\$ (9)	(0,01)	
	07/2023	\$	14 006	€ 13 032	213	0	0,22	
BPS	07/2023	€	12 765	\$ 13 986	59	0	0,06	
	07/2023	\$	14 010	€ 13 032	208	0	0,21	
	08/2023		13 653	12 443	0	(60)	(0,06)	
CBK	07/2023	€	13 530	\$ 14 710	3	(55)	(0,05)	
	08/2023	\$	12 357	€ 11 349	43	0	0,04	
JPM	07/2023	€	12 553	\$ 13 707	11	0	0,01	
	08/2023	\$	13 726	€ 12 553	0	(12)	(0,01)	
MBC	07/2023	€	789	\$ 852	2	(10)	(0,01)	
	07/2023	\$	1 650	€ 1 533	22	0	0,02	
SOG	07/2023		14 020	13 032	199	0	0,21	
					\$ 760	\$ (146)	614	0,63

Au 30 juin 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	07/2023	£	40	\$ 50	\$ 0	\$ 0	0,00	
BPS	07/2023	\$	571	£ 462	16	0	0,02	
CBK	07/2023		58	46	1	0	0,00	
JPM	07/2023	£	479	\$ 605	0	(3)	0,00	
	08/2023	\$	605	£ 479	3	0	0,00	
MBC	07/2023	£	0	\$ 0	0	0	0,00	
	07/2023	\$	570	£ 460	15	0	0,02	
MYI	07/2023		572	460	13	0	0,01	
TOR	07/2023	£	476	\$ 604	0	0	0,00	
	08/2023	\$	604	£ 476	0	0	0,00	
					\$ 48	\$ (3)	45	0,05

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 1 981 2,04

Total des Investissements

\$ 98 404 101,35

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (1 313) (1,35)

Actifs nets

\$ 97 091 100,00

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.

Un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2022 : 2 870 \$) a été nanté en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 49 337	\$ 36 893	\$ 0	\$ 86 230
Fonds d'investissement	9 353	0	0	9 353
Contrats de mise en pension	0	840	0	840
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	0	1 981	0	1 981
Totaux	\$ 58 690	\$ 39 714	\$ 0	\$ 98 404

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 778	\$ (820)	\$ (42)	\$ (129)	\$ 1 610	\$ 1 481
BPS	292	(320)	(28)	S/O	S/O	S/O
CBK	(17)	0	(17)	488	(370)	118
FAR	76	0	76	(18)	550	532
JPM	8	0	8	18	0	18
MBC	59	0	59	305	(310)	(5)
MYI	586	(340)	246	17	710	727
SOG	199	(270)	(71)	466	(270)	196
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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	86,75	54,07
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	2,06	34,95
Fonds d'investissement	9,63	9,85
Contrats de mise en pension	0,87	0,68
Instruments financiers dérivés hors cote	2,04	1,01

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Canada	4,83	9,07
États-Unis	45,98	45,00
Instruments à court terme	38,00	34,95
Fonds d'investissement	9,63	9,85
Contrats de mise en pension	0,87	0,68
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de rendement total sur indices	0,07	(0,01)
Swaps de rendement total sur titres	1,45	(0,10)
Contrats de change à terme	(0,16)	0,08
Contrats de change à terme couverts	0,68	1,04
Autres actifs et passifs à court terme	(1,35)	(0,56)
Actifs nets	100,00	100,00

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
American Home Mortgage Investment Trust				6,643 % éch. 15/07/2031	\$ 600	\$ 503	0,08	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,730 % éch. 25/11/2045	\$ 1 839	\$ 1 624	0,26	6,893 % éch. 15/07/2031	2 000	1 582	0,25	5,400 % éch. 25/05/2036	\$ 2 006	\$ 1 617	0,26
5,883 % éch. 25/09/2035	576	318	0,05	GS Mortgage Securities Trust				Trinity Square PLC			
6,500 % éch. 25/03/2047	1 172	872	0,14	3,932 % éch. 10/10/2035	3 700	3 164	0,51	6,166 % éch. 15/07/2059	£ 3 200	4 033	0,65
Angel Oak Mortgage Trust				GSMPs Mortgage Loan Trust				6,466 % éch. 15/07/2059	2 400	2 997	0,48
2,336 % éch. 25/04/2066	3 638	2 120	0,34	5,550 % éch. 25/04/2036	345	283	0,05	7,216 % éch. 15/07/2059	1 600	1 996	0,32
Ashford Hospitality Trust				7,059 % éch. 20/10/2032	1 220	1 063	0,17	Tudor Rose Mortgages			
8,069 % éch. 15/06/2035	6 900	6 530	1,05	GSMSC Resecuritization Trust				6,059 % éch. 20/06/2048	5 105	6 333	1,02
Atlas Funding PLC				3,126 % éch. 26/04/2037	7 355	2 043	0,33	6,409 % éch. 20/06/2048	9 746	11 946	1,93
6,232 % éch. 25/07/2058	£ 1 150	1 456	0,23	Hops Hill PLC				Twin Bridges PLC			
6,782 % éch. 25/07/2058	950	1 201	0,19	6,754 % éch. 27/05/2054	£ 3 000	3 799	0,61	6,565 % éch. 01/12/2055	3 007	3 554	0,57
Banc of America Funding Trust				7,254 % éch. 27/05/2054	1 100	1 373	0,22	Uropa Securities PLC			
5,763 % éch. 25/10/2036	\$ 1 666	1 448	0,23	HSI Asset Securitization Corp. Trust				4,779 % éch. 10/10/2040	64	78	0,01
Barley Hill PLC				6,110 % éch. 25/07/2035	\$ 1 100	1 044	0,17	4,879 % éch. 10/10/2040	32	39	0,01
6,604 % éch. 27/08/2058	£ 2 953	3 623	0,58	IndyMac Mortgage Loan Trust				Verus Securitization Trust			
BCAP LLC Trust				3,587 % éch. 25/12/2035 ^	3 027	1 921	0,31	2,338 % éch. 25/10/2063	\$ 1 250	989	0,16
5,430 % éch. 25/04/2037	\$ 1 547	1 402	0,23	3,699 % éch. 25/12/2035	332	252	0,04	3,195 % éch. 25/10/2063	1 000	765	0,12
Bear Stearns ALT-A Trust				5,550 % éch. 25/10/2036	3 233	2 790	0,45	4,199 % éch. 25/10/2063	1 000	728	0,12
6,275 % éch. 25/01/2035	1 413	1 306	0,21	JPMorgan Alternative Loan Trust				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
Cascade Funding Mortgage Trust				5,470 % éch. 25/11/2036 ^	4 291	3 580	0,58	3,528 % éch. 25/12/2036 ^	2 231	1 963	0,32
4,000 % éch. 25/10/2068	828	802	0,13	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				3,784 % éch. 25/06/2037 ^	3 137	2 757	0,44
Chase Mortgage Finance Trust				5,350 % éch. 05/07/2033	1 950	1 648	0,27	4,746 % éch. 25/04/2047 ^	62	52	0,01
4,086 % éch. 25/03/2037 ^	49	45	0,01	6,241 % éch. 25/12/2051	60	494	0,08	4,936 % éch. 25/09/2046	928	766	0,12
ChaseFlex Trust				JPMorgan Resecuritization Trust				5,226 % éch. 25/01/2047	661	595	0,10
5,830 % éch. 25/05/2037	1 550	1 469	0,24	4,500 % éch. 26/04/2037	939	459	0,07	5,476 % éch. 25/11/2046	297	262	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust				5,428 % éch. 26/09/2037	1 301	976	0,16	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,000 % éch. 25/12/2035	1 255	1 188	0,19	Lehman Mortgage Trust				4,966 % éch. 25/06/2046	2 027	1 609	0,26
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				6,000 % éch. 25/12/2036	1 451	1 212	0,20	Worldwide Plaza Trust			
4,189 % éch. 25/08/2035	16	15	0,00	Lehman XS Trust				3,715 % éch. 10/11/2036	3 950	2 534	0,41
CitiMortgage Alternative Loan Trust				5,630 % éch. 25/06/2047	5 684	5 120	0,83				
5,700 % éch. 25/01/2037	1 479	1 216	0,20	MASTR Asset Securitization Trust							
6,000 % éch. 25/11/2036	897	801	0,13	6,000 % éch. 25/10/2036	661	581	0,09				
Countrywide Alternative Loan Trust				MASTR Reperforming Loan Trust				TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
4,916 % éch. 25/06/2046	2 058	1 660	0,27	7,000 % éch. 25/07/2035	1 221	867	0,14	Accredited Mortgage Loan Trust			
4,976 % éch. 25/12/2035	1 223	1 091	0,18	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				6,170 % éch. 25/07/2035	2 150	1 990	0,32
5,470 % éch. 25/02/2047	283	257	0,04	6,250 % éch. 25/08/2036	4 086	1 828	0,29	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
5,470 % éch. 25/09/2047	8	7	0,00	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				6,125 % éch. 25/11/2033	676	648	0,11
5,500 % éch. 25/06/2035	142	113	0,02	5,500 % éch. 25/11/2035	1 054	722	0,12	Aegis Asset-Backed Securities Trust			
5,500 % éch. 25/07/2035	2 061	1 486	0,24	6,000 % éch. 25/10/2037	6 311	3 424	0,55	6,150 % éch. 25/03/2035 ^	53	49	0,01
5,500 % éch. 25/10/2035	1 151	832	0,13	Mortgage Equity Conversion Asset Trust				Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
5,500 % éch. 25/11/2035 ^	1 701	996	0,16	5,720 % éch. 25/02/2042	733	708	0,11	6,980 % éch. 25/12/2034	1 073	906	0,15
5,500 % éch. 25/12/2035	237	169	0,03	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				Ameriquet Mortgage Securities Trust			
5,577 % éch. 20/03/2046	497	407	0,07	3,834 % éch. 25/10/2035	936	542	0,09	5,720 % éch. 25/04/2036	6 350	5 339	0,86
5,577 % éch. 20/05/2046 ^	1 813	1 539	0,25	6,017 % éch. 25/06/2037	1 266	1 071	0,17	Ameriquet Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,790 % éch. 25/11/2035	3 966	3 189	0,51	Nomura Resecuritization Trust				6,245 % éch. 25/09/2034	3 079	2 748	0,44
5,850 % éch. 25/09/2035	1 777	1 607	0,26	3,654 % éch. 26/11/2036	1 999	1 762	0,28	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,000 % éch. 25/05/2036	3 510	2 094	0,34	Residential Accredited Loans, Inc. Trust				5,630 % éch. 25/05/2035	2 434	2 194	0,35
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	1 386	605	0,10	5,169 % éch. 25/12/2035	1 198	577	0,09	Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
6,250 % éch. 25/05/2036	272	155	0,02	5,450 % éch. 25/08/2036	857	627	0,10	3,240 % éch. 25/03/2036	1 593	1 351	0,22
6,250 % éch. 25/09/2037	509	347	0,06	6,000 % éch. 25/01/2037 ^	167	129	0,02	6,380 % éch. 25/02/2035	946	921	0,15
Countrywide Asset-Backed Certificates				6,250 % éch. 25/01/2037 ^	966	784	0,13	Attentus CDO Ltd.			
5,650 % éch. 25/03/2036	478	478	0,08	Residential Asset Securitization Trust				5,661 % éch. 11/10/2042	10 034	8 654	1,40
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				6,000 % éch. 25/12/2036 ^	2 987	949	0,15	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
3,514 % éch. 25/04/2035 ^	206	158	0,03	RMAC Securities PLC				4,993 % éch. 25/12/2035	1 678	1 445	0,23
3,666 % éch. 20/11/2035	3 238	2 898	0,47	5,154 % éch. 12/06/2044	£ 377	459	0,07	5,085 % éch. 25/04/2036	1 638	1 628	0,26
3,797 % éch. 20/04/2036	43	37	0,01	Sestante Finance SRL				5,630 % éch. 25/07/2036	388	385	0,06
4,221 % éch. 20/04/2036	558	479	0,08	3,431 % éch. 23/07/2046	€ 886	915	0,15	6,200 % éch. 25/08/2037	8 165	6 853	1,11
5,750 % éch. 25/07/2037 ^	728	380	0,06	Stratton BTL Mortgage Funding PLC				6,350 % éch. 25/01/2045	39	39	0,01
6,500 % éch. 25/11/2037 ^	2 231	860	0,14	6,141 % éch. 20/01/2054	£ 3 000	3 408	0,55	7,025 % éch. 25/07/2034	161	128	0,02
6,500 % éch. 25/12/2037	5 240	2 304	0,37	Stratton Mortgage Funding PLC				Capitalsource Real Estate Loan Trust			
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				6,491 % éch. 20/07/2060	2 200	2 790	0,45	5,861 % éch. 20/01/2037	532	490	0,08
5,500 % éch. 25/10/2021	15	13	0,00	6,642 % éch. 25/09/2051	5 000	6 294	1,01	5,961 % éch. 20/01/2037	350	293	0,05
DBGS Mortgage Trust				6,991 % éch. 20/07/2060	2 500	3 134	0,51	6,061 % éch. 20/01/2037	200	164	0,03
6,743 % éch. 15/06/2033	2 422	2 097	0,34	7,491 % éch. 20/07/2060	3 600	4 521	0,73	Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC			
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				7,865 % éch. 12/03/2052	1 400	1 738	0,28	6,754 % éch. 21/10/2028	£ 3 200	4 055	0,65
5,347 % éch. 19/10/2036	4 590	3 807	0,61	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				7,704 % éch. 21/10/2028	8 775	10 923	1,76
Eurosail PLC				4,238 % éch. 25/07/2035	\$ 1 573	791	0,13	Castlelake Aircraft Securitization Trust			
3,709 % éch. 13/03/2045	€ 550	574	0,09	4,706 % éch. 25/05/2035	988	780	0,13	4,125 % éch. 15/06/2043	\$ 1 878	1 697	0,27
3,936 % éch. 10/09/2044	800	823	0,13	5,282 % éch. 25/02/2034	7	7	0,00	Citigroup Mortgage Loan Trust			
5,540 % éch. 13/06/2045	£ 1 673	1 821	0,29	5,450 % éch. 25/02/2037	474	455	0,07	5,470 % éch. 25/12/2036	3 320	1 866	0,30
5,989 % éch. 13/06/2045	309	358	0,06	5,590 % éch. 25/06/2037	319	283	0,05	Conseco Finance Corp.			
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				5,649 % éch. 25/12/2034	1 672	1 539	0,25	6,920 % éch. 01/12/2030	2 029	2 028	0,33
6,084 % éch. 25/07/2035	\$ 182	166	0,03	Structured Asset Mortgage Investments Trust				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
Grifonas Finance PLC				5,370 % éch. 25/09/2047	3 203	2 672	0,43	5,300 % éch. 25/04/2047 ^	5	5	0,00
3,513 % éch. 28/08/2039	€ 903	939	0,15	5,690 % éch. 25/08/2035	482	431	0,07				
GS Mortgage Securities Corp. Trust				6,271 % éch. 19/12/2033	379	356	0,06				
4,579 % éch. 10/10/2032	\$ 5 821	5 546	0,89	Structured Asset Securities Corp.							
				5,400 % éch. 25/07/2035	1 368	1 241	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
5,370 % éch. 25/09/2037 ^	\$ 2 096	\$ 2 103	0,34	Long Beach Mortgage Loan Trust	\$ 142	\$ 117	0,02	Sapphire Aviation Finance Ltd.	\$ 5 392	\$ 4 493	0,72
5,370 % éch. 25/09/2047 ^	932	891	0,14	5,750 % éch. 25/02/2036	112	112	0,02	4,250 % éch. 15/03/2040	2 201	1 499	0,24
5,633 % éch. 25/06/2035	92	78	0,01	6,170 % éch. 25/08/2033	€ 4 700	4 444	0,72	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust	43	41	0,01
5,850 % éch. 25/03/2036 ^	1 871	1 615	0,26	1,700 % éch. 15/10/2030	5 000	4 829	0,78	5,270 % éch. 25/09/2036	5 834	4 792	0,77
5,859 % éch. 25/10/2046 ^	12	12	0,00	MAPS Ltd.	\$ 1 938	1 731	0,28	SoFi Professional Loan Program LLC	6 050	5 388	0,87
6,125 % éch. 25/01/2036	67	65	0,01	4,212 % éch. 15/05/2043	160	159	0,03	Soundview Home Loan Trust	6 140	683	0,10
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.	75	73	0,01	MASTR Asset-Backed Securities Trust	686	674	0,11	5,320 % éch. 25/07/2037	5 465	4 049	0,65
6,125 % éch. 25/10/2034	276	276	0,05	5,730 % éch. 25/12/2035	685	674	0,11	6,050 % éch. 25/10/2037	11 187	6 020	0,97
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC	2 105	1 384	0,22	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust	792	685	0,11	6,140 % éch. 25/06/2035	312	300	0,05
2,817 % éch. 25/05/2036	276	276	0,05	6,230 % éch. 25/10/2035	5 290	443	0,07	6,275 % éch. 25/04/2035	88	87	0,01
3,289 % éch. 25/03/2034	2 974	1 822	0,29	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust	5 400	8 390	1,35	Taberna Preferred Funding Ltd.	3 739	3 515	0,57
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust	399	392	0,06	5,400 % éch. 25/07/2036	3 443	1 320	0,21	5,666 % éch. 05/05/2038	233	207	0,03
First Franklin Mortgage Loan Trust	5 972	4 602	0,74	5,450 % éch. 25/07/2036	3 443	1 330	0,21	5,693 % éch. 05/07/2035	200	193	0,03
5,810 % éch. 25/01/2036	4 084	1 370	0,22	5,650 % éch. 25/07/2036	0	0	0,00	Terwin Mortgage Trust	6 095	5 849	0,94
Fremont Home Loan Trust	4 000	3 082	0,50	5,720 % éch. 25/12/2035	0	0	0,00	4,147 % éch. 15/09/2038	6 836	5 849	0,94
5,430 % éch. 25/02/2037	1 977	1 761	0,28	5,750 % éch. 25/12/2035	0	0	0,00	7,080 % éch. 20/09/2039	2 363	2 257	0,36
5,630 % éch. 25/08/2036	3 767	1 849	0,30	Morgan Stanley Capital, Inc. Trust	1 854	1 774	0,29	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust	1 146	1 118	0,18
6,080 % éch. 25/07/2035	1 950	1 702	0,27	5,730 % éch. 25/01/2036	141	74	0,01	5,570 % éch. 25/03/2037	184 735	29,78	
Goodgreen Trust	694	641	0,10	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust	141	74	0,01				
3,930 % éch. 15/10/2053	1 977	1 761	0,28	5,250 % éch. 25/04/2037	141	74	0,01				
GSAA Home Equity Trust	3 767	1 849	0,30	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust	3 566	1 453	0,23				
5,610 % éch. 25/04/2047	1 950	1 702	0,27	5,450 % éch. 25/07/2036	2 236	2 124	0,34				
5,870 % éch. 25/10/2035	694	641	0,10	National Collegiate Student Loan Trust	4 936	4 432	0,72				
GSAMP Trust	1 263	1 176	0,19	5,290 % éch. 25/03/2037	4 936	4 432	0,72				
5,420 % éch. 25/03/2047	800	796	0,13	Option One Mortgage Loan Trust	335	324	0,05				
Harley Marine Financing LLC	1 263	1 176	0,19	6,725 % éch. 25/02/2035	238	245	0,04				
6,682 % éch. 15/05/2043	949	912	0,15	6,800 % éch. 25/12/2034	2 407	2 252	0,36				
Harvest CLO DAC	€ 800	796	0,13	5,690 % éch. 25/05/2036 ^	379	350	0,06				
1,040 % éch. 15/07/2031	695	690	0,11	Renaissance Home Equity Loan Trust	5 982	2 898	0,47				
Home Equity Asset Trust	5,470 % éch. 25/08/2036	564	0,09	5,608 % éch. 25/05/2036	1 362	675	0,11				
3,883 % éch. 25/02/2036	306	290	0,05	5,746 % éch. 25/05/2036	200	188	0,03				
5,470 % éch. 25/08/2036	6 643	4 336	0,70	Residential Asset Mortgage Products Trust	703	680	0,11				
5,630 % éch. 25/08/2037	5 390 % éch. 25/04/2037	6 643	4 336	5,690 % éch. 25/02/2036	1 400	1 335	0,22				
6,440 % éch. 25/08/2033	194	167	0,03	Residential Asset Securities Corp. Trust	38	37	0,01				
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust	5 952	3 139	0,51	4,906 % éch. 25/06/2034	2 131	2 010	0,32				
5,390 % éch. 25/04/2037	3 827 % éch. 15/04/2031	400	426	0,07	5,585 % éch. 25/06/2036	1 400	1 335	0,22			
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust	€ 400	426	0,07	6,095 % éch. 25/05/2035	38	37	0,01				
3,967 % éch. 25/11/2036	3 500	3 292	0,53	6,185 % éch. 25/08/2035	2 131	2 010	0,32				
5,270 % éch. 25/12/2036	1 800 % éch. 20/10/2031	3 500	3 292	0,53							
Jubilee CLO DAC	\$ 3 169	2 899	0,47								
Laurelin DAC											
1,800 % éch. 20/10/2031											
Lehman XS Trust											
5,570 % éch. 25/06/2046											

INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
5,207 % éch.			
10/08/2023 (d)(e)	4 800	4 774	0,77
Total des Instruments à court terme		4 774	0,77
Total des Valeurs mobilières	\$ 1 421 861		229,21
ACTIONS			
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc -			
Fonds PIMCO US Dollar			
Short-Term Floating			
NAV Fund (g)	2 399	24	0,00
Total des Fonds d'investissement	\$ 24		0,00

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⁾	
							\$	\$	\$	\$
FICC	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 241	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	\$ (246)	\$ 241	\$ 241	\$ 0,04	
	2,400	30/06/2023	03/07/2023	3 767	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	(3 842)	3 767	3 767	0,61	
Total des Contrats de mise en pension						\$ (4 088)	\$ 4 008	\$ 4 008	0,65	

(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 SOFR à 3 mois décembre	Long	03/2024	62	\$ (40)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	89	62	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Long	06/2024	54	(12)	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2023	27	9	0,00
Contrats à terme standardisés sur Fonds fédéraux à 30 jours février	Court	02/2024	45	133	0,02
Contrats à terme standardisés sur Fonds fédéraux à 30 jours novembre	Long	11/2023	45	(90)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Court	09/2023	155	283	0,05
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	27	56	0,01

Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities 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 10 ans septembre	Long	09/2023	135	\$ (256)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	174	363	0,06
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	27	(53)	(0,01)
				\$ 455	0,07

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	159	\$ (69)	\$ (60)	(0,01)
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	159	(56)	(8)	0,00
				\$ (125)	\$ (68)	(0,01)

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 387 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 TAUX D'INTÉRÊT

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 ⁽¹⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250 %	20/09/2053	£ 400	\$ 36	0,01
À payer ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,827	03/07/2028	\$ 85 485	(7 951)	(1,28)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,998	09/03/2025	31 400	1 572	0,25
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,999	03/07/2053	17 445	3 883	0,63
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,034	02/03/2025	57 500	2 902	0,47
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2030	35 300	1 188	0,19
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	3 100	(119)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	35 100	703	0,11
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,260	08/06/2033	3 300	50	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	21/06/2026	8 600	218	0,03
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2030	10 300	26	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,505	08/03/2033	900	(2)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,510	08/03/2033	2 500	5	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,513	08/03/2030	12 000	116	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,635	08/03/2030	5 400	10	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,500	21/06/2024	300 400	1 412	0,23
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,250	18/03/2050	€ 2 400	1 045	0,17
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	13 100	(116)	(0,02)
					\$ 4 978	0,80

Total des Instruments financiers dérivés compensés

\$ 4 978 0,80

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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 notional ⁽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	5,500 %	18/09/2023	88 600	\$ 198	\$ 108	0,02
	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
BPS	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	1 732	0,28
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,800	20/12/2023	5 300	107	30	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,550	20/12/2023	15 800	319	300	0,05
BRC	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	120	0,02
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,800	20/12/2023	5 200	107	29	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,550	20/12/2023	15 800	319	300	0,05
CBK	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	105	0,02
	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	568	0,09
	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	1 419	0,23
DUB	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	255	0,04
	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	57	0,01
	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	38	12	0,00
	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	24	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	15	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,040	11/01/2024	11 100	106	94	0,02
	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	13	0,00

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 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,995 %	16/01/2024	10 400	\$ 101	\$ 97	0,02
	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 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	1 776	0,29
	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	4	0,00
	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	837	0,13
	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	841	0,14
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	5,500	18/09/2023	85 600	188	105	0,02
	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	151	0,02
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,000	26/10/2023	2 200	66	13	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	126	0,02
	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	579	0,09
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,655	12/12/2023	21 200	462	83	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,405	12/12/2023	21 200	462	495	0,08
	JPM	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	60
MYC	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	89	0,01
	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	39	0,01
	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	11	0,00
	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	156	0,03
	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	93	0,02
							\$ 6 592	\$ 10 736	1,73

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net		
JPM	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 2,000 % échéance 01/07/2053	\$ 116,000	06/07/2023	200 000	\$ 8	\$ 0	0,00		
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 2,000 % échéance 01/08/2053	115,000	07/08/2023	15 000	1	0	0,00		
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 2,500 % échéance 01/08/2053	116,000	07/08/2023	20 000	1	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 3,000 % échéance 01/09/2053	70,000	07/09/2023	10 700	0	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/08/2053	72,000	07/08/2023	35 000	1	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/09/2053	72,000	07/09/2023	5 000	0	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/07/2053	72,000	06/07/2023	100 000	4	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/08/2053	72,000	07/08/2023	90 000	2	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/08/2053	74,000	07/08/2023	13 000	1	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/07/2053	76,000	06/07/2023	75 000	3	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/08/2053	75,000	07/08/2023	24 000	1	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/08/2053	77,000	07/08/2023	30 000	1	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/08/2053	76,000	07/09/2023	5 000	0	0	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/09/2053	77,000	07/08/2023	15 000	1	0	0,00		
	SAL	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/07/2053	98,766	06/07/2023	3 000	4	0	0,00	
		Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/09/2053	97,898	07/09/2023	12 500	39	45	0,01	
								\$ 67	\$ 45

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 de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	5,750 %	18/09/2023	44 300	\$ (78)	\$ (24)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	6,000	18/09/2023	44 300	(66)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	5 600	(37)	(14)	0,00
CBK	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	5 600	(37)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,740	06/07/2023	1 500	(5)	(3)	0,00
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)	(157)	(0,03)
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	5,750	18/09/2023	42 800	(75)	(23)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	6,000	18/09/2023	42 800	(62)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,043	03/08/2023	14 800	(185)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,043	03/08/2023	14 800	(185)	(544)	(0,09)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,045	07/09/2023	9 800	(39)	(39)	(0,01)
							\$ (802)	\$ (829)	(0,14)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net		
BOA	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/07/2053	\$ 93,984	06/07/2023	4 000	\$ (10)	\$ (14)	0,00		
JPM	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/07/2053	95,281	06/07/2023	6 000	(22)	(1)	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/08/2053	94,172	07/08/2023	15 000	(173)	(139)	(0,02)		
MSC	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/07/2053	93,281	06/07/2023	5 000	(20)	(5)	0,00		
SAL	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/07/2053	93,859	06/07/2023	3 500	(7)	(10)	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/07/2053	94,000	06/07/2023	3 500	(7)	(13)	0,00		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/08/2053	95,672	07/08/2023	10 000	(60)	(51)	(0,01)		
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/08/2053	95,875	07/08/2023	2 000	(12)	(12)	0,00		
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/08/2053	97,672	07/08/2023	10 000	(55)	(18)	(0,01)		
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/08/2053	97,875	07/08/2023	2 000	(11)	(3)	0,00		
							\$ (377)	\$ (266)	(0,04)

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

Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities 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
BRC	07/2023	£ 498	\$ 618	\$ 0	\$ (15)	\$ (15)	0,00
CBK	07/2023	€ 16 338	\$ 17 532	0	(293)	(293)	(0,05)
	07/2023	\$ 496	£ 388	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07/2023	€ 211	\$ 226	0	(5)	(5)	0,00
MYI	07/2023	\$ 95	£ 103	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 24	£ 19	0	0	0	0,00
UAG	07/2023	£ 64 660	\$ 80 576	0	(1 630)	(1 630)	(0,26)
				\$ 0	\$ (1 945)	\$ (1 945)	(0,31)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 5 840	CAD 7 946	\$ 165	\$ 0	\$ 165	0,03
BPS	07/2023	CAD 174	\$ 131	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	\$ 5 829	CAD 7 943	174	0	174	0,03
GLM	07/2023	34	46	1	0	1	0,00
MBC	07/2023	133	178	2	0	2	0,00
SCX	07/2023	5 856	7 953	154	0	154	0,02
				\$ 496	\$ 0	\$ 496	0,08

Au 30 juin 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
BPS	07/2023	CHF 896	\$ 1 002	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 1 217	CHF 1 101	13	0	13	0,00
	08/2023	1 002	893	0	0	0	0,00
CLY	07/2023	CHF 473	\$ 527	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	\$ 527	CHF 472	2	0	2	0,00
MBC	07/2023	CHF 18	\$ 20	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 273	CHF 245	1	0	1	0,00
MYI	07/2023	CHF 11	\$ 12	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 51	CHF 45	0	0	0	0,00
RYL	07/2023	CHF 40	\$ 45	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	\$ 912	CHF 820	4	0	4	0,00
UAG	07/2023	CHF 980	\$ 1 094	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	\$ 822	CHF 739	4	0	4	0,00
	08/2023	1 025	917	2	0	2	0,00
				\$ 26	\$ (4)	\$ 22	0,00

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	\$ 51 657	€ 48 065	\$ 783	\$ 0	\$ 783	0,12
BPS	07/2023	€ 48 723	\$ 53 383	226	0	226	0,04
	07/2023	\$ 52 395	€ 48 719	766	(8)	758	0,12
	08/2023	52 756	48 080	0	(229)	(229)	(0,04)
CBK	07/2023	€ 48 312	\$ 52 526	0	(184)	(184)	(0,03)
	07/2023	\$ 1 446	€ 1 324	3	(4)	(1)	0,00
	08/2023	52 348	48 081	181	0	181	0,03
JPM	07/2023	€ 48 081	\$ 52 500	43	0	43	0,01
	07/2023	\$ 51 241	€ 47 926	1 047	0	1 047	0,17
	08/2023	52 573	48 081	0	(45)	(45)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 932	\$ 998	0	(19)	(19)	0,00
	07/2023	\$ 705	€ 643	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 3 049	\$ (492)	\$ 2 557	0,41

Au 30 juin 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	07/2023	£ 196	\$ 248	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$ 13	£ 10	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	£ 14	\$ 17	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 4 634	£ 3 746	129	0	129	0,02
BRC	07/2023	£ 575	\$ 713	0	(17)	(17)	0,00
	07/2023	\$ 6	£ 5	0	0	0	0,00
CBK	07/2023	£ 404	\$ 511	0	(3)	(3)	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
JPM	07/2023	\$ 19	£ 15	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	£ 3 578	\$ 4 524	0	(25)	(25)	0,00
	08/2023	\$ 4 525	£ 3 578	25	0	25	0,00
MBC	07/2023	4 654	3 759	125	0	125	0,02
MYI	07/2023	4 627	3 723	106	0	106	0,02
SCX	07/2023	892	717	20	0	20	0,00
TOR	07/2023	£ 3 599	\$ 4 574	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	\$ 4 575	£ 3 599	2	0	2	0,00
				\$ 407	\$ (48)	\$ 359	0,06
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ 11 175	1,80

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			
2,000 % éch. 01/08/2053	\$ 7 900	\$ (6 646)	(1,07)
2,500 % éch. 01/08/2053	26 200	(22 708)	(3,66)
4,000 % éch. 01/08/2053	4 800	(4 546)	(0,73)
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/07/2038	29 800	(26 410)	(4,26)
2,000 % éch. 01/07/2053	65 954	(53 802)	(8,67)
2,000 % éch. 01/08/2053	149 796	(122 370)	(19,73)
2,500 % éch. 01/07/2053	7 100	(6 022)	(0,97)
3,000 % éch. 01/07/2038	500	(466)	(0,07)
3,000 % éch. 01/08/2053	57 750	(50 908)	(8,21)
4,000 % éch. 01/07/2038	3 700	(3 572)	(0,58)
4,000 % éch. 01/08/2053	57 000	(53 542)	(8,63)
4,500 % éch. 01/08/2053	16 050	(15 439)	(2,49)
5,000 % éch. 01/08/2053	24 200	(23 718)	(3,82)
Total des Titres vendus à découvert	\$ (390 149)	(62,89)	
Total des Investissements	\$ 1 052 284	169,63	
Autres actifs et passifs à court terme	\$ (431 948)	(69,63)	
Actifs nets	\$ 620 336	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 principal uniquement.

(c) Titre vendu avant l'émission.

(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) Des titres d'une juste valeur globale de 354 567 \$ (31 décembre 2022 : 324 164 \$) et un montant en numéraire de 569 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 0 \$ (31 décembre 2022 : 4 656 \$) 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 8 177 \$ (31 décembre 2022 : 4 327 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 1 230 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 1 417 010	\$ 4 851	\$ 1 421 861
Fonds d'investissement	24	0	0	24
Contrats de mise en pension	0	4 008	0	4 008
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	0	16 540	0	16 540
Titres vendus à découvert	0	(390 149)	0	(390 149)
Totaux	\$ 24	\$ 1 047 409	\$ 4 851	\$ 1 052 284

Tableau des investissements Fonds Mortgage 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	\$ 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 30 juin 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	5,180 %	20/06/2023	13/07/2023	\$ (6 759)	\$ (6 770)	(1,09)
CIB	5,180	15/06/2023	13/07/2023	(337 645)	(338 422)	(54,56)
Total des Contrats de prise en pension					\$ (345 192)	(55,65)

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 991	\$ (790)	\$ 201	\$ (3 187)	\$ 2 810	\$ (377)
BPS	2 959	(2 920)	39	3 438	(3 310)	128
BRC	417	(390)	27	500	(480)	20
CBK	1 961	(2 090)	(129)	11 235	(10 950)	285
CLY	S/O	S/O	S/O	11	0	11
DUB	3 868	(4 050)	(182)	6 229	(5 990)	239
GLM	934	(910)	24	1 201	(1 080)	121
JPM	965	50	1 015	(743)	730	(13)
MBC	101	0	101	2 699	(2 490)	209
MSC	(5)	0	(5)	(94)	0	(94)
MYC	388	(300)	88	2 285	(2 410)	(125)
MYI	106	(20)	86	(6)	0	(6)
SAL	(62)	0	(62)	(418)	480	62
SCX	178	0	178	1 971	(1 850)	121
TOR	S/O	S/O	S/O	4	0	4
UAG	(1 626)	1 180	(446)	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	42,02	25,41
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	187,19	174,84
Autres valeurs mobilières	S/O	2,90
Fonds d'investissement	0,00	0,00
Contrats de mise en pension	0,65	2,04
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,06	0,54
Instruments financiers dérivés compensés	0,80	(0,35)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,80	2,96
Titres vendus à découvert	(62,89)	(61,03)
Contrats de prise en pension	(55,65)	(37,27)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	0,12	0,10
Agences du gouvernement américain	165,12	121,51
Obligations du Trésor américain	1,11	0,51
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	32,31	37,20
Titres adossés à des actifs	29,78	35,71
Instruments à court terme	0,77	8,12
Fonds d'investissement	0,00	0,00
Contrats de mise en pension	0,65	2,04
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,07	0,54
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de taux d'intérêt	0,80	(0,35)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	1,73	3,42
Options sur titres	0,01	0,00
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,14)	(1,08)
Options sur titres	(0,04)	(0,20)
Contrats de change à terme	(0,31)	0,14
Contrats de change à terme couverts	0,55	0,68
Titres vendus à découvert	(62,89)	(61,03)
Autres actifs et passifs à court terme	(69,63)	(47,31)
Actifs nets	100,00	100,00

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 %	20/12/2023	\$ 6 300	\$ (62)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	2 500	(24)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2026	1 100	(10)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2028	700	5	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2023	3 100	(14)	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20/12/2024	800	(1)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	1 700	6	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	3 700	1	0,00
				\$ (99)	(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.IG-39 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	\$ 4 500	\$ 21	0,00
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	304 500	1 468	0,08
				\$ 1 489	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	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750 %	15/06/2024	\$ 237 900	\$ 1 140	0,07
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	22 900	(223)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	28 900	252	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,875	07/02/2050	300	135	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	15/01/2050	900	416	0,02
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	20/03/2050	1 900	867	0,05
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	3 200	94	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2030	7 100	201	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	7 200	61	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	12 300	247	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	20/12/2030	12 300	101	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	21/06/2025	41 100	(802)	(0,05)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	21/06/2025	29 300	(9)	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	20/12/2028	16 700	131	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,875	07/08/2023	300	1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/07/2023	900	3	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	20/09/2023	1 900	8	0,00
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	€ 23 200	294	0,02
À recevoir	CPURNSA	2,418	11/07/2052	\$ 5 700	153	0,01
					\$ 3 070	0,18
					\$ 4 460	0,25

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.

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	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	\$ 6 071	10/01/2024	\$ 0	\$ 375	\$ 375	0,02
FAR	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	2 731	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	24 489	02/08/2023	0	1 512	1 512	0,08
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	167	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	1 498	15/11/2023	0	92	92	0,01
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	3 736	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	34 215	05/06/2024	0	1 386	1 386	0,08

Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ 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 S&P 500 Total Return Index	21 307	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	\$ 199 758	26/06/2024	\$ 0	\$ 3 687	\$ 3 687	0,20	
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	16 775	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	157 269	18/10/2023	0	2 905	2 905	0,16	
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	9 621	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	86 273	06/03/2024	0	5 327	5 327	0,29	
RBC	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	5 404	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	48 459	20/03/2024	0	2 992	2 992	0,17	
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	24 342	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	218 279	19/07/2023	0	13 474	13 474	0,75	
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	398	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	3 569	26/07/2023	0	220	220	0,01	
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	6 655	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	62 392	18/10/2023	0	1 152	1 152	0,06	
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	340	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	3 049	17/01/2024	0	188	188	0,01	
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	5 593	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	49 360	24/01/2024	0	3 841	3 841	0,21	
UBS	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	13 035	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	116 887	21/02/2024	0	7 220	7 220	0,41	
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	340	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	3 049	15/05/2024	0	188	188	0,01	
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	2 522	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	22 615	13/09/2023	0	1 397	1 397	0,08	
								\$ 0	\$ 45 956	\$ 45 956	2,55

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	07/2023	DKK 10 803	\$ 1 560	\$ 0	\$ (23)	\$ (23)	0,00	
	07/2023	€ 6 093	6 590	0	(57)	(57)	0,00	
	07/2023	\$ 2 881	DKK 19 592	0	(11)	(11)	0,00	
	08/2023	DKK 19 559	\$ 2 881	11	0	11	0,00	
	09/2023	\$ 6	TWD 176	0	0	0	0,00	
	07/2023	€ 1 430	\$ 1 558	0	(2)	(2)	0,00	
BPS	07/2023	NZD 56	34	0	(1)	(1)	0,00	
	07/2023	\$ 274 541	€ 250 565	0	(1 175)	(1 175)	(0,07)	
	07/2023	4 772	£ 3 750	0	(5)	(5)	0,00	
	08/2023	€ 249 045	\$ 273 261	1 183	0	1 183	0,07	
	08/2023	\$ 3	TWD 88	0	0	0	0,00	
	10/2023	32	ZAR 590	0	(1)	(1)	0,00	
BRC	07/2023	£ 13 681	\$ 17 028	0	(366)	(366)	(0,02)	
CBK	07/2023	€ 842	909	0	(10)	(10)	0,00	
	07/2023	£ 12 034	15 093	0	(206)	(206)	(0,01)	
	07/2023	\$ 24 791	€ 23 082	394	(3)	391	0,02	
CLY	07/2023	DKK 31 749	\$ 4 583	0	(69)	(69)	0,00	
	GLM	10/2023	\$ 90	ZAR 1 695	0	(1)	(1)	0,00
	JPM	07/2023	€ 27 140	\$ 29 017	0	(592)	(592)	(0,03)
	07/2023	£ 817	1 033	0	(6)	(6)	0,00	
	08/2023	\$ 1 033	£ 817	6	0	6	0,00	
	MBC	07/2023	CAD 149	\$ 110	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	£ 40 684	50 361	0	(1 362)	(1 362)	(0,08)	
	07/2023	\$ 6 538	€ 6 067	83	(2)	81	0,00	
	MYI	07/2023	€ 436	\$ 475	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 2 561	DKK 17 472	0	(1)	(1)	0,00	
	08/2023	DKK 17 443	\$ 2 561	1	0	1	0,00	
	08/2023	\$ 3	TWD 95	0	0	0	0,00	
RBC	08/2023	13	MXN 222	0	0	0	0,00	
SCX	07/2023	NZD 134	\$ 81	0	(1)	(1)	0,00	
SOG	07/2023	€ 244 209	262 705	0	(3 728)	(3 728)	(0,21)	
	TOR	07/2023	\$ 87	CAD 115	0	0	0	0,00
	07/2023	80 646	£ 63 466	41	0	41	0,00	
	07/2023	116	NZD 190	1	0	1	0,00	
	08/2023	CAD 115	\$ 87	0	0	0	0,00	
	08/2023	£ 63 466	80 664	0	(40)	(40)	0,00	
08/2023	NZD 190	116	0	(1)	(1)	0,00		
				\$ 1 720	\$ (7 667)	\$ (5 947)	(0,33)	

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 16	\$ 17	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 54 107	€ 50 344	819	0	819	0,05
BPS	07/2023	€ 59 902	\$ 65 621	273	(6)	267	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
	07/2023	\$ 53 681	€ 49 929	\$ 792	\$ 0	\$ 792	0,04
	08/2023	\$ 63 825	€ 58 169	0	(276)	(276)	(0,02)
CBK	07/2023	€ 54 491	\$ 59 256	6	(199)	(193)	(0,01)
	07/2023	\$ 2 851	€ 2 654	45	0	45	0,00
	08/2023	\$ 57 140	€ 52 483	197	0	197	0,01
JPM	07/2023	€ 59 024	\$ 64 448	53	0	53	0,00
	08/2023	\$ 64 538	€ 59 024	0	(55)	(55)	0,00
MBC	07/2023	€ 1 272	\$ 1 364	0	(24)	(24)	0,00
	07/2023	\$ 454	€ 417	2	(1)	1	0,00
RYL	07/2023	\$ 23 285	€ 21 764	459	0	459	0,03
SOG	07/2023	\$ 53 292	€ 49 540	756	0	756	0,04
				\$ 3 402	\$ (561)	\$ 2 841	0,16

Au 30 juin 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	07/2023	£ 1	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 46	£ 37	1	0	1	0,00
CBK	07/2023	3	2	0	(1)	(1)	0,00
CLY	07/2023	168	133	1	0	1	0,00
MBC	07/2023	£ 2	\$ 2	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 39	£ 31	1	0	1	0,00
MYI	07/2023	39	31	1	0	1	0,00
SCX	07/2023	39	31	1	0	1	0,00
				\$ 5	\$ (1)	\$ 4	0,00

Au 30 juin 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
BRC	07/2023	SGD 1	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 111	SGD 151	0	0	0	0,00
CLY	07/2023	3	4	0	0	0	0,00
MBC	07/2023	92	124	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	SGD 3	\$ 3	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 102	SGD 138	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ 42 854	2,38
Total des Investissements						\$ 1 893 236	104,95
Autres actifs et passifs à court terme						\$ (89 277)	(4,95)
Actifs nets						\$ 1 803 959	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 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) Un titre d'une juste valeur globale de 1 292 \$ (31 décembre 2022 : 0 \$) et un montant en numéraire de 2 200 \$ (31 décembre 2022 : 40 550 \$) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 58 286 \$ (31 décembre 2022 : 45 395 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 1 011 308	\$ 116	\$ 1 011 424
Fonds d'investissement	163 028	0	0	163 028
Contrats de mise en pension	0	651 113	0	651 113
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	19 925	47 746	0	67 671
Totaux	\$ 182 953	\$ 1 710 167	\$ 116	\$ 1 893 236

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	740	(580)	160	(428)	290	(138)
BPS	782	(850)	(68)	4	0	4
BRC	(366)	343	(23)	9	0	9
CBK	598	(560)	38	2 647	(2 506)	141
CLY	(68)	0	(68)	(53)	0	(53)
FAR	6 677	(3 480)	3 197	(1 148)	18 390	17 242
GLM	(1)	0	(1)	(184)	0	(184)
JPM	10 630	(6 960)	3 670	753	(700)	53
MBC	(1 306)	949	(357)	(1 953)	3 760	1 807
MYI	0	(10)	(10)	(224)	0	(224)
RBC	26 283	(20 470)	5 813	(1 063)	16 910	15 847
RYL	459	(490)	(31)	S/O	S/O	S/O
SCX	S/O	S/O	S/O	2 420	(2 270)	150
SOG	(2 972)	2 200	(772)	S/O	S/O	S/O
TOR	1	0	1	S/O	S/O	S/O
UAG	0	(970)	(970)	2	620	622
UBS	1 397	0	1 397	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	39,76	33,61
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	16,30	35,70
Autres valeurs mobilières	S/O	1,24
Fonds d'investissement	9,04	9,19
Contrats de mise en pension	36,09	15,52
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	1,13	(1,39)
Instruments financiers dérivés compensés	0,25	(0,37)
Instruments financiers dérivés hors cote	2,38	0,01

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	4,99	6,99
Agences du gouvernement américain	5,98	0,59
Obligations du Trésor américain	3,06	S/O
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	15,16	25,04
Titres adossés à des actifs	15,11	22,85
Émissions souveraines	0,63	S/O
Instruments à court terme	11,13	15,08
Fonds d'investissement	9,04	9,19
Contrats de mise en pension	36,09	15,52
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	1,13	(1,39)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,01)	(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	0,18	0,03
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de rendement total sur indices	2,55	(0,24)
Contrats de change à terme	(0,33)	(0,30)
Contrats de change à terme couverts	0,16	0,55
Autres actifs et passifs à court terme	(4,95)	6,49
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				5,915 % éch. 25/11/2035	\$ 35	\$ 19	0,16	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				5,360 % éch. 25/10/2036	\$ 24	\$ 23	0,20
BANQUE ET FINANCE				5,610 % éch. 25/05/2035	80	68	0,59	Jubilee CLO DAC			
Avolon Holdings Funding Ltd.				Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				3,787 % éch. 15/04/2030	€ 100	107	0,93
2,528 % éch. 18/11/2027	\$ 43	\$ 36	0,31	5,590 % éch. 25/11/2034	10	10	0,09	Man GLG Euro CLO DAC			
Goldman Sachs Group, Inc.				CSAIL Commercial Mortgage Trust				4,047 % éch. 15/01/2030			
6,941 % éch. 15/03/2028	100	102	0,88	3,504 % éch. 15/06/2057	100	95	0,82	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				Dutch Property Finance BV				6,005 % éch. 25/03/2034	\$ 62	60	0,52
2,750 % éch. 09/03/2028	50	41	0,36	4,492 % éch. 28/04/2050	€ 46	50	0,43	Mountain View CLO Ltd.			
Nykredit Realkredit A/S				Frost CMBS DAC				6,592 % éch. 13/10/2027	196	196	1,70
1,500 % éch. 01/10/2053	DKK 700	77	0,67	4,533 % éch. 20/11/2033	99	104	0,90	Oak Hill European Credit Partners DAC			
Wells Fargo & Co.				GSR Mortgage Loan Trust				3,930 % éch. 20/01/2032	€ 93	99	0,86
1,338 % éch. 04/05/2025	€ 100	106	0,92	3,657 % éch. 25/11/2035	\$ 16	14	0,12	Palmer Square European Loan Funding DAC			
		362	3,14	Mortgage Equity Conversion Asset Trust				4,727 % éch. 15/11/2032	100	109	0,94
				5,720 % éch. 25/02/2042	91	88	0,76	5,025 % éch. 12/04/2032	95	105	0,91
				Precise Mortgage Funding PLC				Pretium Mortgage Credit Partners LLC			
INDUSTRIE				6,065 % éch. 12/12/2055	£ 56	71	0,62	2,240 % éch. 27/09/2060	\$ 104	98	0,85
Expeda Group, Inc.				Shamrock Residential DAC						1 949	16,88
6,250 % éch. 01/05/2025	\$ 44	44	0,38	4,289 % éch. 24/01/2061	€ 83	89	0,77				
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				Structured Asset Mortgage Investments Trust				INSTRUMENTS À COURT TERME			
Pacific Gas & Electric Co.				5,646 % éch. 19/07/2035	\$ 22	20	0,17	BILLETS À COURT TERME			
4,550 % éch. 01/07/2030	5	5	0,04	5,770 % éch. 25/09/2045	11	10	0,09	Federal Home Loan Bank			
Total des Obligations et billets privés		411	3,56	Structured Asset Securities Corp.				5,120 % éch. 17/11/2023	500	500	4,33
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				5,430 % éch. 25/10/2036	11	9	0,08	BONS DU TRÉSOR JAPONAIS			
Freddie Mac				5,500 % éch. 25/03/2035	41	35	0,30	(0,206) % éch. 18/07/2023			
5,176 % éch. 25/02/2045	44	42	0,36			807	6,98	(a)(b)	¥ 20 000	138	1,19
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				(0,200) % éch. 14/08/2023			
4,000 % éch. 01/08/2053	700	658	5,70	Ares European CLO DAC				(a)(b)	20 000	139	1,20
5,000 % éch. 01/09/2053	200	196	1,70	3,837 % éch. 15/10/2030	€ 99	106	0,92	(0,197) % éch. 31/07/2023			
5,500 % éch. 01/08/2053	400	398	3,45	Armadia Euro CLO DAC				(a)(b)	23 000	159	1,38
6,000 % éch. 01/07/2053	200	202	1,75	3,897 % éch. 15/07/2031	100	107	0,92	(0,188) % éch. 18/07/2023			
6,500 % éch. 01/07/2053	300	306	2,65	Avoca CLO DAC				(a)(b)	10 000	69	0,60
		1 802	15,61	3,867 % éch. 15/07/2030	73	78	0,67	(0,186) % éch. 07/08/2023			
				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				(a)(b)	20 000	138	1,20
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				5,470 % éch. 25/08/2036	\$ 80	76	0,66	(0,178) % éch. 31/07/2023			
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c)				6,400 % éch. 25/08/2037	15	15	0,13	(0,176) % éch. 14/08/2023			
0,625 % éch. 15/07/2032	209	192	1,66	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				(a)(b)	10 000	69	0,60
				4,137 % éch. 16/01/2033	€ 100	106	0,92	(0,166) % éch. 07/08/2023			
				Contego CLO DAC				(a)(b)	10 000	69	0,60
TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				3,851 % éch. 23/01/2030	100	107	0,93			830	7,19
American Home Mortgage Assets Trust				Fremont Home Loan Trust				BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
4,896 % éch. 25/11/2046	238	73	0,63	5,765 % éch. 25/11/2035	\$ 100	86	0,74	5,166 % éch. 08/08/2023			
Banc of America Alternative Loan Trust				Griffith Park CLO DAC				(a)(b)	\$ 1 000	995	8,63
6,000 % éch. 25/03/2021 ^	12	9	0,08	4,103 % éch. 21/11/2031	€ 100	107	0,93	Total des Instruments à court terme		2 325	20,15
Banc of America Mortgage Trust				GSA Home Equity Trust				Total des Valeurs mobilières	\$ 7 486	64,84	
5,188 % éch. 25/06/2034	5	4	0,03	7,025 % éch. 25/02/2035	\$ 100	96	0,83				
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				GSAMP Trust				ACTIONS			
4,541 % éch. 25/05/2037	11	9	0,08	5,290 % éch. 25/12/2036	141	76	0,66	FONDS D'INVESTISSEMENT			
Chase Mortgage Finance Trust				Home Equity Loan Trust				ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
4,529 % éch. 25/07/2037	2	1	0,01	5,380 % éch. 25/04/2037	69	67	0,58	PIMCO Select Funds plc -			
Countrywide Alternative Loan Trust				HSI Asset Securitization Corp. Trust				Fonds PIMCO			
4,976 % éch. 25/12/2035	22	20	0,17	5,930 % éch. 25/01/2036	100	78	0,67	US Dollar Short-Term			
5,500 % éch. 25/11/2035	13	9	0,08					Floating NAV Fund (d)	74 314	740	6,40
								FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
								PIMCO ETFs plc - PIMCO			
								US Dollar Short			
								Maturity UCITS ETF	3 800	377	3,27
								(d)			
								Total des Fonds d'investissement	\$ 1 117	9,67	

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	5,160 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 2 100	Billets du Trésor américain 2,000 % éch. 15/08/2025	\$ (2 145)	\$ 2 100	\$ 2 101	18,19
	5,170	30/06/2023	03/07/2023	1 800	Ginnie Mae 2,500 % éch. 20/10/2051	(1 863)	1 800	1 801	15,59
SSB	2,400	30/06/2023	03/07/2023	118	Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 30/06/2026	(120)	118	118	1,02
Total des Contrats de mise en pension						\$ (4 128)	\$ 4 018	\$ 4 020	34,80

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR 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 Indice E-mini S&P 500 Index septembre	Long	09/2023	5	\$ 30	0,26
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	1	1	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	7	(15)	(0,13)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	8	17	0,15
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	13	(25)	(0,22)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	1	0	0,00
				\$ 8	0,07
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ 8	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 - 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 à 5 ans	5,000 %	20/06/2028	\$ 200	\$ 6	0,05
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	5 900	33	0,28
				\$ 39	0,33

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	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,407 %	21/07/2024	\$ 200	\$ (12)	(0,11)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2028	200	(21)	(0,17)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,740	15/02/2027	100	(12)	(0,10)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	16/12/2025	350	(34)	(0,29)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	16/12/2027	300	44	0,38
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	17/06/2030	100	22	0,19
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/06/2051	100	20	0,18
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,277	21/07/2031	200	38	0,31
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	18/12/2029	200	21	0,19
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	600	3	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	700	21	0,18
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,500	18/12/2024	100	9	0,08
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/06/2053	100	3	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2030	200	3	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	400	(16)	(0,13)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	200	3	0,02
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	20/12/2028	100	1	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	21/07/2023	400	0	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/09/2023	200	(3)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,740	15/08/2023	100	(1)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/09/2023	50	(1)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/09/2023	100	1	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/09/2023	100	1	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/09/2023	200	2	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,500	18/09/2023	100	1	0,01
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	€ 90	(2)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	200	2	0,02
					\$ 93	0,81
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 132	1,14

⁽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.

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
BRC	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	111	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	\$ 995	04/10/2023	\$ 0	\$ 62	\$ 62	0,53
CBK	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	170	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	1 524	10/01/2024	0	94	94	0,82
FAR	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	155	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	1 390	02/08/2023	0	86	86	0,74
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	85	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	762	27/09/2023	0	47	47	0,41
RBC	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	569	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	5 102	21/02/2024	0	315	315	2,73
							\$ 0	\$ 604	\$ 604	5,23

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	07/2023	DKK 141	\$ 20	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 38	DKK 255	0	0	0	0,00
	08/2023	DKK 255	\$ 38	0	0	0	0,00
BRC	08/2023	€ 10	\$ 11	0	0	0	0,00
	07/2023	¥ 30 000	232	25	0	25	0,22
	08/2023	£ 3	4	0	0	0	0,00
CBK	08/2023	\$ 16	£ 13	0	0	0	0,00
CLY	07/2023	DKK 413	\$ 60	0	(2)	(2)	(0,01)
JPM	08/2023	£ 32	40	0	0	0	0,00
MBC	08/2023	€ 1 323	1 460	13	0	13	0,11
MYI	07/2023	\$ 33	DKK 227	0	0	0	0,00
	08/2023	DKK 227	\$ 33	0	0	0	0,00
RBC	07/2023	\$ 0	MXN 0	0	0	0	0,00
	08/2023	£ 6	\$ 8	0	0	0	0,00
	08/2023	MXN 0	0	0	0	0	0,00
SSB	07/2023	¥ 30 000	227	19	0	19	0,16
	08/2023	30 000	226	17	0	17	0,15
UAG	08/2023	£ 28	35	0	0	0	0,00
	08/2023	¥ 30 000	221	13	0	13	0,11
	08/2023	\$ 6	€ 6	0	0	0	0,00
				\$ 87	\$ (2)	\$ 85	0,74

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
CBK	07/2023	\$ 8	£ 6	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
MBC	07/2023	£ 7	\$ 9	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 305	£ 246	9	0	9	0,07
MYI	07/2023	306	246	7	0	7	0,06
SCX	07/2023	311	249	6	0	6	0,06
				\$ 22	\$ 0	\$ 22	0,19

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 711 6,16

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION

AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN

Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA

2,500 % éch. 01/07/2053

	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
	\$ 400	(339)	(2,94)

Total des Titres vendus à découvert

\$ (339) (2,94)

Total des Investissements

\$ 13 133 113,74

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (1 586) (13,74)

Actifs nets

\$ 11 547 100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR 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 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 299 \$ (31 décembre 2022 : 221 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 7 467	\$ 19	\$ 7 486
Fonds d'investissement	1 117	0	0	1 117
Contrats de mise en pension	0	4 018	0	4 018
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	31	820	0	851
Titres vendus à découvert	0	(339)	0	(339)
Totaux	\$ 1 148	\$ 11 966	\$ 19	\$ 13 133

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ S/O	\$ S/O	\$ S/O	\$ (43)	\$ 0	\$ (43)
BRC	87	(80)	7	(4)	80	76
CBK	94	0	94	7	0	7
CLY	(2)	0	(2)	(1)	0	(1)
DUB	S/O	S/O	S/O	(47)	0	(47)
FAR	133	0	133	(16)	280	264
GLM	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)
MBC	22	0	22	(19)	0	(19)
MYI	7	0	7	S/O	S/O	S/O
RBC	315	(300)	15	(17)	280	263
RYL	S/O	S/O	S/O	(26)	0	(26)
SCX	6	0	6	3	0	3
SSB	36	0	36	S/O	S/O	S/O
UAG	13	0	13	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	22,68	20,10
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	42,16	61,13
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	S/O	0,10
Fonds d'investissement	9,67	9,49
Contrats de mise en pension	34,80	14,42
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,07	(0,07)
Instruments financiers dérivés compensés	1,14	1,43
Instruments financiers dérivés hors cote	6,16	(1,72)
Titres vendus à découvert	(2,94)	(6,12)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	3,56	8,52
Agences du gouvernement américain	15,61	7,38
Obligations du Trésor américain	1,66	1,25
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	6,98	9,36
Titres adossés à des actifs	16,88	20,52
Instruments à court terme	20,15	34,30
Fonds d'investissement	9,67	9,49
Contrats de mise en pension	34,80	14,42
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,07	(0,07)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,33	0,46
Swaps de taux d'intérêt	0,81	0,97
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de rendement total sur indices	5,23	(0,39)
Contrats de change à terme	0,74	(1,42)
Contrats de change à terme couverts	0,19	0,09
Titres vendus à découvert	(2,94)	(6,12)
Autres actifs et passifs à court terme	(13,74)	1,24
Actifs nets	100,00	100,00

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
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA (c)	19 286	\$ 164	0,04	Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	93	\$ 22	0,01	Uniti Group, Inc.	1 773	\$ 8	0,00
		2 335	0,51			2 573	0,56	VICI Properties, Inc.	127 561	4 009	0,87
		114 309	24,75					WP Carey, Inc.	16 419	1 109	0,24
										25 108	5,44
DROITS				SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER							
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025	11 842	71	0,01	Apartment Income REIT Corp.	34 879	1 259	0,27	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
BONS DE SOUSCRIPTION				Apple Hospitality REIT, Inc.	90 002	1 360	0,29				
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060	706	0	0,00	Boston Properties, Inc.	16 967	977	0,21				
Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17/02/2027	1 128	2	0,00	CareTrust REIT, Inc.	29 200	580	0,13				
Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21/09/2055	2 586	39	0,01	CBL & Associates Properties, Inc.	378	8	0,00	INSTRUMENTS A COURT TERME			
		41	0,01	Cousins Properties, Inc.	26 939	614	0,13	BONS DU TRÉSOR ARGENTIN			
TITRES PRIVILÉGIÉS				Digital Realty Trust, Inc.	12 073	1 375	0,30	(54,758) % éch. 18/09/2023			
Bayerische Motoren Werke AG 0,000 %	2 105	240	0,05	EPR Properties	25 499	1 193	0,26	(d)(e) ARS	12 728	25	0,01
Nationwide Building Society 10,250 %	6 220	911	0,20	Equity Residential	10 526	694	0,15	(28,578) % éch. 18/10/2023	160 664	318	0,07
Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 %	168 800	1 033	0,22	Gaming and Leisure Properties, Inc.	37 448	1 815	0,39	(d)(e)	150 893	304	0,06
Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A. 0,000 %	5 036	367	0,08	Healthcare Realty Trust, Inc.	58 968	1 112	0,24	Total des Instruments à court terme		647	0,14
				Healthpeak Properties, Inc.	44 877	902	0,20	Total des Valeurs mobilières	\$	597 009	129,25
				Highwoods Properties, Inc.	30 875	738	0,16	ACTIONS			
				Kilroy Realty Corp.	23 258	700	0,15	ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
				Macerich Co.	51 482	580	0,13	PIMCO Select Funds plc -			
				National Storage Affiliates Trust	35 455	1 235	0,27	Fonds PIMCO US Dollar			
				Park Hotels & Resorts, Inc.	100 691	1 291	0,28	Short-Term Floating NAV Fund (g)			
				Physicians Realty Trust	32 220	451	0,10	2 337 401			
				Simon Property Group, Inc.	17 922	2 070	0,45	23 276			
				Spirit Realty Capital, Inc.	26 095	1 028	0,22	5,04			
								Total des Fonds d'investissement			
								\$ 23 276 5,04			

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 2 001	Billets du Trésor américain 4,625 % éch. 30/06/2025	\$ (2 041)	\$ 2 001	\$ 2 001	0,43
Total des Contrats de mise en pension						\$	(2 041)	\$ 2 001	0,43

(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	15	\$ 100	0,02
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2025	7	31	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2026	8	26	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	10	58	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2025	9	33	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2024	13	83	0,02
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2025	7	28	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2026	9	27	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2024	10	51	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2025	6	21	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Court	09/2023	103	43	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	42	58	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	12	(26)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	412	(712)	(0,16)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Long	09/2023	11	(13)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Court	09/2023	154	6	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	126	(247)	(0,05)
				\$ (433)	(0,09)

OPTIONS VENDUES**OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	6	\$ (3)	\$ (2)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	6	(2)	0	0,00
Option de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	123,000	21/07/2023	2	(1)	0	0,00

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

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 du Trésor américain à 30 ans CBOT août	\$ 131,000	21/07/2023	2	\$ (1)	\$ 0	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,000	15/09/2023	8	(13)	(1)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,063 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,063	15/12/2023	9	(18)	(2)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,125 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,125	15/12/2023	8	(15)	(2)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,188 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,188	15/09/2023	13	(25)	(1)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 96,375 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,375	15/12/2023	13	(27)	(2)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	98,000	15/12/2023	8	(7)	0	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,000	15/09/2023	8	(15)	(28)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,063 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,063	15/12/2023	9	(18)	(33)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,125 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,125	15/12/2023	8	(15)	(31)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,188 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	96,188	15/09/2023	13	(26)	(52)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,375 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,375	15/12/2023	13	(28)	(57)	(0,01)
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	8	(7)	(38)	(0,01)
				\$ (221)	\$ (249)	(0,06)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					\$ (682)	(0,15)

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
General Electric Co.	1,000 %	20/12/2023	\$ 300	\$ 16	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.EM-30 à 5 ans	1,000 %	20/12/2023	\$ 3 145	\$ 161	0,03
Indice CDX.EM-31 à 5 ans	1,000	20/06/2024	946	39	0,01
Indice CDX.EM-32 à 5 ans	1,000	20/12/2024	510	24	0,01
Indice CDX.EM-34 à 5 ans	1,000	20/12/2025	2 208	11	0,00
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000	20/12/2026	6 440	120	0,03
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	900	39	0,01
Indice CDX.EM-39 à 5 ans	1,000	20/06/2028	1 900	50	0,01
Indice CDX.HY-36 à 5 ans	5,000	20/06/2026	1 862	(83)	(0,02)
Indice CDX.HY-37 à 5 ans	5,000	20/12/2026	882	(4)	0,00
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	2 772	77	0,02
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	5,000	20/06/2028	6 100	147	0,03
Indice CDX.IG-40 à 5 ans	1,000	20/06/2028	600	6	0,00
				\$ 587	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 recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500 %	20/09/2033	£ 6 200	\$ 450	0,10
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/03/2029	¥ 2 430 000	313	0,07
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,020	20/09/2028	2 950 000	318	0,07
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,176	27/04/2027	160 000	0	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	410 000	27	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2042	220 000	50	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,711	27/04/2042	40 000	11	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/07/2023	\$ 1 400	19	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	18/07/2023	1 100	15	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	02/08/2023	300	4	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/08/2023	52 700	727	0,16
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	06/09/2023	2 300	32	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	15/09/2023	33 800	(472)	(0,10)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	16/09/2023	50 200	(716)	(0,16)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	20/09/2023	10 900	(152)	(0,03)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2026	32 900	3 177	0,69
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,500	16/06/2028	26 200	(2 550)	(0,55)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	15/12/2024	53 300	(3 044)	(0,66)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	16/06/2031	13 442	(1 476)	(0,32)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,750	16/06/2031	16 200	2 109	0,46
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,940	08/06/2026	2 000	185	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	15 700	(1 518)	(0,33)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	1 200	89	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	2 770	(322)	(0,07)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	16/12/2030	1 766	308	0,07
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,235	12/05/2028	700	88	0,02
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2026	500	58	0,01
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2026	33 800	4 124	0,89

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⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250 %	17/06/2027	\$ 12 000	\$ (1 715)	(0,37)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2028	3 900	(587)	(0,13)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	17/06/2030	47 620	5 294	1,15
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	5 950	(641)	(0,14)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/06/2051	4 300	(923)	(0,20)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,270	04/11/2023	52 700	(863)	(0,19)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,350	20/01/2027	3 400	339	0,07
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,360	20/07/2031	800	140	0,03
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,370	19/07/2031	500	87	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,380	04/01/2027	1 400	(146)	(0,03)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,405	07/09/2031	1 300	222	0,05
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,425	18/01/2027	1 000	(95)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,443	18/01/2027	1 100	(111)	(0,02)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,450	17/02/2027	2 400	227	0,05
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,450	16/07/2031	1 200	205	0,04
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,491	21/01/2051	900	(310)	(0,07)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/12/2028	7 130	(990)	(0,21)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	12/01/2029	578	74	0,02
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	05/10/2031	600	(99)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,535	15/10/2031	600	(97)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,535	22/10/2031	400	(64)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,545	26/10/2031	400	(64)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,550	20/01/2027	15 100	(1 358)	(0,29)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,570	11/01/2027	800	(73)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,580	16/02/2027	900	(79)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,590	09/02/2051	7 200	(2 366)	(0,51)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,600	16/01/2026	6 600	242	0,05
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,625	16/01/2050	3 100	1 025	0,22
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,625	03/02/2050	3 900	1 290	0,28
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	06/03/2024	2 300	(55)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	17/02/2027	9 600	(797)	(0,17)
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,700	12/01/2029	2 100	(238)	(0,05)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,740	16/12/2026	1 100	105	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	26 000	850	0,18
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	1 209	58	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	1 878	102	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	1 840	(174)	(0,04)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	22/01/2050	7 600	2 377	0,51
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,768	02/02/2032	300	(46)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,785	12/08/2051	700	222	0,05
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,817	05/04/2032	2 200	(297)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,872	06/04/2032	1 100	(143)	(0,03)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,875	07/02/2050	400	115	0,02
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,895	18/10/2049	700	214	0,05
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,910	17/10/2049	700	211	0,05
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,928	25/03/2027	1 100	(90)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2027	1 250	29	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2029	5 740	136	0,03
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	18/02/2032	900	(113)	(0,03)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	9 130	209	0,04
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	15/01/2050	1 400	380	0,08
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	15/12/2051	6 500	(2 182)	(0,47)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,250	11/12/2049	7 100	1 562	0,34
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,250	12/03/2050	3 400	745	0,16
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,300	17/01/2026	4 600	167	0,04
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,350	17/01/2025	7 900	184	0,04
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	15 900	377	0,08
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,500	18/12/2024	6 000	534	0,12
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,500	20/12/2024	10 900	191	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,850	30/08/2027	1 000	(52)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,955	04/10/2027	1 000	(46)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	19/06/2024	41 600	2 177	0,47
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	19/06/2026	32 300	2 287	0,49
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2030	2 090	28	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	2 800	95	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/06/2033	160	(4)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	07/09/2027	500	(22)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	500	(22)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	06/09/2032	700	(30)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,080	23/02/2053	200	(4)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	500	(20)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	690	9	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/06/2028	590	(1)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,300	06/03/2033	300	(7)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,300	14/06/2033	1 000	(18)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,340	23/02/2030	600	(15)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,350	14/12/2032	200	6	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,370	01/03/2033	400	(7)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,400	23/02/2033	200	(3)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,405	01/03/2033	300	(4)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,425	01/03/2033	300	(4)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,430	27/02/2033	300	(4)	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	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,450 %	07/03/2033	\$ 600	\$ (6)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	600	(10)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/06/2030	900	(8)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	22/05/2033	29 660	(83)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,500	21/06/2033	600	0	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	200	(3)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,610	12/12/2032	400	3	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,700	06/06/2033	16 970	(42)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	13/12/2027	900	16	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	600	(5)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,040	20/06/2024	2 000	(15)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,060	20/06/2024	8 100	(60)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,140	22/06/2024	3 400	(22)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,500	22/05/2025	65 460	(279)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	4,900	06/06/2025	37 050	(17)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	5,100	22/05/2024	126 930	(140)	(0,03)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	5,400	06/06/2024	71 750	63	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,140	02/01/2025	BRL 1 300	(5)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,160	02/01/2025	800	(3)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,220	04/01/2027	1 500	3	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,245	04/01/2027	700	2	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,260	04/01/2027	800	2	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,350	02/01/2025	1 000	(3)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,700	04/01/2027	400	2	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,715	04/01/2027	1 700	9	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,870	04/01/2027	4 000	25	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	12,000	02/01/2025	2 800	1	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,080	02/01/2025	4 700	3	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,140	02/01/2025	2 300	2	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,145	02/01/2025	2 300	2	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,160	02/01/2025	4 700	5	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/07/2023	\$ 1 400	(19)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	18/07/2023	1 100	(15)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	02/08/2023	300	(4)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/08/2023	52 700	(723)	(0,16)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	06/09/2023	2 300	(32)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	15/09/2023	33 800	480	0,10
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	16/09/2023	50 200	721	0,16
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,000	20/09/2023	10 900	153	0,03
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/09/2023	26 200	(343)	(0,07)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,750	15/09/2023	53 300	(656)	(0,14)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/09/2023	13 442	(167)	(0,04)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,940	08/09/2023	2 000	24	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/09/2023	1 766	21	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,235	12/08/2023	700	8	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/09/2023	500	6	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/09/2023	4 300	(48)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/09/2023	35 620	382	0,08
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,350	20/07/2023	3 400	23	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	20/07/2023	800	5	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,370	19/07/2023	500	3	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,405	07/09/2023	1 300	9	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,425	18/07/2023	1 000	(6)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	16/07/2023	1 200	7	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	17/08/2023	2 400	15	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,491	21/07/2023	900	(5)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	05/07/2023	600	(6)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	12/07/2023	578	3	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/09/2023	7 130	(74)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	15/07/2023	600	(6)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	22/07/2023	400	(4)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,545	26/07/2023	400	(4)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,550	20/07/2023	15 100	(85)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	11/07/2023	800	(4)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,580	16/08/2023	900	(5)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,590	09/08/2023	7 200	(41)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,625	16/07/2023	3 100	16	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,625	03/08/2023	3 900	21	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	12/07/2023	2 100	(10)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	17/08/2023	9 600	(50)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	22/07/2023	7 600	35	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,785	12/08/2023	700	4	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,875	07/08/2023	400	2	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,895	18/07/2023	700	6	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,910	17/07/2023	700	6	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/07/2023	1 400	5	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	18/08/2023	900	(3)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/09/2023	6 500	(60)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,250	11/09/2023	7 100	60	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,250	12/09/2023	3 400	10	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,500	18/09/2023	6 000	46	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	3,000	19/09/2023	73 900	477	0,10

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	2,750 %	17/06/2026	AUD 460	\$ (18)	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,000	21/03/2027	18 640	(979)	(0,21)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,250	17/12/2024	1 600	(81)	(0,02)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,500	17/06/2025	19 492	(1 255)	(0,27)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	17/12/2024	650	(59)	(0,01)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,750	18/06/2024	460	(42)	(0,01)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,150	18/03/2030	€ 6 200	1 255	0,27
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,250	18/03/2050	2 300	1 001	0,22
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,329	30/12/2025	100	11	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,363	30/06/2025	200	18	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,395	30/12/2024	100	7	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,425	28/06/2024	200	10	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,453	29/12/2023	200	5	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052	6 800	331	0,07
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,000	21/09/2032	11 880	(1 115)	(0,24)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	11/04/2024	1 400	(22)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	13/04/2024	2 900	(46)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,100	17/05/2024	1 300	(22)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	26/04/2024	1 400	(19)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	28/04/2024	1 300	(19)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	03/05/2024	1 300	(19)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	800	(18)	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	3 700	(44)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	5,160	06/06/2025	MXN 9 300	(46)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	5,535	04/05/2027	18 500	(112)	(0,02)
À payer	TIE MXN à 28 jours	5,950	30/01/2026	12 300	5	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	5,980	26/09/2024	600	0	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	5,990	30/01/2026	15 000	5	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,080	10/03/2026	20 700	1	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,350	01/09/2023	3 300	6	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,490	08/09/2026	13 700	(9)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,620	18/02/2030	600	0	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,710	20/09/2029	500	0	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,150	11/06/2027	28 100	(49)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,165	06/09/2032	3 000	(3)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,200	11/06/2027	2 900	(5)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,360	21/08/2037	3 100	(6)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,370	11/10/2027	14 800	(30)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,380	04/11/2026	400	(1)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	7,380	14/08/2037	700	0	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,480	18/06/2037	1 300	(3)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	7,495	14/01/2032	8 100	(15)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	7,498	15/01/2032	33 500	(64)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,603	14/04/2025	49 000	(116)	(0,03)
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,610	15/04/2025	3 000	(7)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,670	05/03/2025	52 900	(111)	(0,02)
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,710	07/03/2025	6 400	(14)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,715	07/03/2025	6 300	(13)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	7,800	28/12/2027	2 900	4	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,818	17/02/2027	11 400	(35)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	7,865	02/02/2027	11 900	(37)	(0,01)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	7,910	30/12/2027	600	1	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	7,984	10/12/2027	6 800	7	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	7,990	21/12/2027	100	0	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,005	21/12/2027	37 500	60	0,01
À payer	TIE MXN à 28 jours	8,010	04/02/2027	5 200	(18)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,030	31/01/2028	4 600	4	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,050	31/01/2028	3 400	2	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	8,090	15/01/2027	13 000	(48)	(0,01)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,103	04/01/2038	5 600	(2)	0,00
À payer	TIE MXN à 28 jours	8,120	15/01/2027	2 700	(10)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,410	31/03/2027	11 100	5	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,660	04/04/2024	38 500	43	0,01
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,675	03/04/2024	92 600	103	0,02
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,701	31/03/2032	19 500	(41)	(0,01)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,730	06/04/2027	16 500	(1)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,732	30/03/2032	8 200	(18)	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	8,750	05/04/2024	39 700	43	0,01
À payer	IPC Royaume-Uni	4,000	15/09/2031	£ 300	(57)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,020	15/10/2031	400	(73)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,055	15/09/2031	400	(75)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,066	15/09/2031	600	(101)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,140	15/10/2031	1 000	(168)	(0,04)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,250	15/11/2031	900	(128)	(0,03)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,400	15/10/2031	400	(59)	(0,01)
					\$ 6 699	1,45
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 7 302	1,58

⁽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

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

(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.

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 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	1 100	\$ (3)	\$ 0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	1 100	(3)	(15)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,380	31/07/2023	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	3,780	31/07/2023	300	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	200	(1)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,060	14/07/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,360	14/07/2023	100	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	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	3,650	06/07/2023	200	(1)	0	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	100	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	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	3,660	26/07/2023	100	0	(1)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	200	0	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	200	0	(1)	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	300	(2)	0	0,00
CBK	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)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	1 000	(6)	0	0,00
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	1 000	(6)	(23)	(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	600	(5)	(1)	0,00
FAR	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)	(11)	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)	(1)	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)	(18)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,100	31/08/2023	800	(6)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	31/08/2023	800	(6)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	700	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	700	(4)	(15)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	500	(3)	0	0,00
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	500	(3)	(10)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	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	3,140	23/10/2023	500	(4)	(10)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	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	3,190	23/10/2023	500	(4)	(9)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	500	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	500	(3)	(9)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	600	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	600	(4)	(12)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	600	(4)	0	0,00
JPM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	600	(4)	(13)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	600	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	600	(4)	(12)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	600	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	600	(4)	(13)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	1 100	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	1 100	(4)	(14)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	1 100	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	1 100	(4)	(15)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	1 100	(3)	0	0,00
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	1 100	(3)	(14)	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	1 200	(9)	(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	1 200	(9)	(22)	(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)	(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	600	(5)	(11)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	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	3,660	26/07/2023	300	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	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	10/07/2023	200	(1)	0	0,00
JPM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	10/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,250	20/07/2023	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	3,650	20/07/2023	300	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	600	(4)	0	0,00
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	600	(4)	(13)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	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	3,650	06/07/2023	200	(1)	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
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300 %	10/07/2023	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	3,750	10/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	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	3,670	24/07/2023	300	(1)	(1)	0,00
							\$ (212)	\$ (291)	(0,06)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel ⁽¹⁾	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
SAL	Option de vente - OTC Uniform Mortgage-Backed Security TBA 4,500 % éch. 01/08/2053	\$ 95,875	07/08/2023	500	\$ (3)	\$ (2)	0,00
	Option d'achat - OTC Uniform Mortgage-Backed Security TBA 4,500 % éch. 01/08/2053	97,875	07/08/2023	500	(3)	(1)	0,00
					\$ (6)	\$ (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
BOA	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000 %	20/12/2023	\$ 400	\$ (29)	\$ 27	\$ (2)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	100	(11)	7	(4)	0,00
BPS	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	200	(18)	9	(9)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	300	(14)	8	(6)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	900	(62)	58	(4)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	400	(36)	28	(8)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	940	(110)	73	(37)	(0,01)
CBK	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	0	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	100	(4)	1	(3)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	700	(11)	17	6	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	100	(10)	6	(4)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	600	(9)	14	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	100	(4)	1	(3)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	100	(9)	5	(4)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	800	(7)	16	9	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2028	300	(5)	5	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	100	(5)	5	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	400	(36)	28	(8)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	900	(101)	66	(35)	(0,01)
HUS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2023	200	(6)	7	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2024	1 000	(29)	37	8	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	100	(3)	3	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2026	300	(2)	6	4	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	800	(44)	45	1	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	200	(7)	1	(6)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	200	(18)	9	(9)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	600	(5)	11	6	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	9	12	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2027	400	(1)	5	4	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2028	1 700	(39)	37	(2)	0,00
					\$ (642)	\$ 562	\$ (80)	(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	\$ 311	\$ (73)	\$ 61	\$ (12)	0,00
DUB	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	400	(7)	5	(2)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17/01/2047	225	(10)	10	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	16 000	(8)	(56)	(64)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	7 300	(38)	(13)	(51)	(0,01)
	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	8 700	(339)	337	(2)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17/09/2058	298	(12)	11	(1)	0,00
MEI	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	500	(4)	(2)	(6)	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	596	(47)	46	(1)	0,00
MYC	Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25/05/2046	493	(115)	95	(20)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	500	(4)	(2)	(6)	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	(25)	(8)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	1 200	6	(14)	(8)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	300	(1)	(2)	(3)	0,00

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

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
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500 %	17/09/2058	\$ 15 400	\$ 15	\$ (44)	\$ (29)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17/10/2057	100	(6)	6	0	0,00
					\$ (643)	\$ 430	\$ (213)	(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
AZD	07/2023	AUD 1 090	\$ 723	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	07/2023	\$ 245	AUD 375	4	0	4	0,00
	08/2023	724	1 090	2	0	2	0,00
BOA	07/2023	KRW 122 877	\$ 94	1	0	1	0,00
	07/2023	MXN 14 546	790	0	(57)	(57)	(0,01)
	07/2023	\$ 1 369	AUD 2 099	29	0	29	0,01
BPS	08/2023	1 357	NZD 2 140	0	(46)	(46)	(0,01)
	09/2023	TWD 14 084	\$ 464	11	0	11	0,00
	09/2023	\$ 762	KRW 965 543	0	(26)	(26)	(0,01)
BRC	07/2023	AUD 865	\$ 572	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	CHF 141	157	0	0	0	0,00
	07/2023	KRW 18 299	14	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 10 660	€ 9 729	0	(45)	(45)	(0,01)
	07/2023	436	£ 343	0	0	0	0,00
	07/2023	6 065	¥ 842 591	0	(236)	(236)	(0,05)
	08/2023	CNH 2 308	\$ 334	16	0	16	0,00
	08/2023	€ 9 571	10 502	45	0	45	0,01
	08/2023	KRW 1 222 113	932	3	0	3	0,00
	08/2023	TWD 7 050	231	4	0	4	0,00
	08/2023	\$ 517	AUD 779	3	0	3	0,00
	08/2023	157	CHF 140	0	0	0	0,00
	08/2023	9	CNY 62	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	678	INR 55 704	0	0	0	0,00
	CBK	08/2023	ZAR 14 618	\$ 788	17	0	17
09/2023		\$ 906	IDR 13 614 837	0	(2)	(2)	0,00
10/2023		ZAR 36 636	\$ 1 968	50	0	50	0,01
12/2023		MXN 555	31	0	0	0	0,00
07/2023		KRW 124 146	95	1	0	1	0,00
08/2023		ZAR 15 914	857	19	(1)	18	0,00
09/2023		IDR 24 061	2	0	0	0	0,00
07/2023		PEN 3 410	939	0	(2)	(2)	0,00
07/2023		\$ 990	CLP 801 308	8	0	8	0,00
07/2023		918	PEN 3 410	23	0	23	0,01
08/2023		TWD 7 339	\$ 240	5	0	5	0,00
08/2023		\$ 1 041	CLP 851 403	13	0	13	0,00
08/2023		710	NOK 7 408	0	(18)	(18)	0,00
08/2023		536	PEN 2 094	40	0	40	0,01
09/2023		KRW 123 275	\$ 95	1	0	1	0,00
08/2023	\$ 802	NOK 8 403	0	(16)	(16)	0,00	
CLY	07/2023	PEN 3 410	\$ 932	0	(8)	(8)	0,00
DUB	07/2023	\$ 6 131	BRL 33 218	756	0	756	0,16
FAR	07/2023	1 871	PEN 6 820	10	0	10	0,00
	10/2023	ZAR 3 684	\$ 202	9	0	9	0,00
	07/2023	\$ 2	CLP 1 229	0	0	0	0,00
GLM	07/2023	BRL 33 323	\$ 6 901	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	KRW 48 362	37	0	0	0	0,00
	08/2023	583 955	444	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 1 047	INR 86 012	0	0	0	0,00
	08/2023	312	NOK 3 313	0	(3)	(3)	0,00
	09/2023	6 901	BRL 33 692	5	0	5	0,00
	10/2023	ZAR 6 536	\$ 348	6	0	6	0,00
	07/2023	£ 343	434	0	(2)	(2)	0,00
	07/2023	¥ 286 941	2 006	21	0	21	0,00
	07/2023	MXN 4 651	270	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	CNH 1 853	268	13	0	13	0,00
	08/2023	KRW 102 898	78	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 10	CNY 66	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	434	£ 343	2	0	2	0,00
	08/2023	2 006	¥ 285 722	0	(21)	(21)	0,00
08/2023	115	NOK 1 222	0	(1)	(1)	0,00	
08/2023	167	ZAR 3 060	0	(6)	(6)	0,00	
JPM	09/2023	IDR 40 474	\$ 3	0	0	0	0,00
	09/2023	KRW 343 306	264	2	0	2	0,00
	09/2023	PEN 1 888	513	0	(5)	(5)	0,00
	09/2023	\$ 1	IDR 8 789	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
	12/2023	\$ 713	INR 58 839	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
MBC	07/2023	£ 5 561	\$ 6 884	0	(187)	(187)	(0,04)
	08/2023	NZD 447	272	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	\$ 1 403	KRW 1 789 835	0	(39)	(39)	(0,01)
MYI	07/2023	IDR 122 234	\$ 8	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 292	€ 268	0	0	0	0,00
	07/2023	8	IDR 122 234	0	0	0	0,00
	08/2023	TWD 14 254	\$ 469	11	0	11	0,00
	08/2023	\$ 113	ZAR 2 076	0	(4)	(4)	0,00
	09/2023	IDR 122 340	\$ 8	0	0	0	0,00
	09/2023	KRW 663 661	511	5	0	5	0,00
	09/2023	\$ 496	IDR 7 402 494	0	(4)	(4)	0,00
	09/2023	1 572	KRW 2 011 485	0	(39)	(39)	(0,01)
RBC	07/2023	AUD 101	\$ 69	2	0	2	0,00
	07/2023	\$ 5 141	MXN 98 927	618	0	618	0,13
	08/2023	MXN 19 475	\$ 1 124	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07/2023	AUD 1 601	\$ 1 063	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$ 1 443	AUD 2 209	27	0	27	0,01
	07/2023	165	CHF 148	1	0	1	0,00
	08/2023	CNH 878	\$ 128	7	0	7	0,00
	08/2023	NZD 2 360	1 435	0	(11)	(11)	0,00
	08/2023	TWD 5 257	172	3	0	3	0,00
	08/2023	\$ 1 064	AUD 1 601	3	0	3	0,00
	08/2023	724	CNH 4 969	0	(38)	(38)	(0,01)
	08/2023	474	NZD 760	0	(9)	(9)	0,00
	09/2023	KRW 122 797	\$ 95	1	0	1	0,00
	09/2023	TWD 11 780	386	7	0	7	0,00
	09/2023	\$ 2 122	IDR 31 725 606	0	(14)	(14)	0,00
	09/2023	ZAR 9 141	\$ 521	41	0	41	0,01
SOG	07/2023	€ 9 729	10 466	0	(149)	(149)	(0,03)
	07/2023	\$ 1 620	AUD 2 476	28	0	28	0,01
SSB	07/2023	CLP 803 688	\$ 1 000	0	0	0	0,00
	07/2023	KRW 91 511	70	0	0	0	0,00
	07/2023	PEN 3 410	935	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023	\$ 1 000	CLP 806 009	0	0	0	0,00
	08/2023	934	PEN 3 410	5	0	5	0,00
	09/2023	2 916	BRL 14 782	115	0	115	0,03
	12/2023	73	INR 6 025	0	0	0	0,00
TOR	07/2023	AUD 1 971	\$ 1 302	0	(10)	(10)	0,00
	07/2023	\$ 857	AUD 1 310	15	0	15	0,00
	07/2023	7 066	£ 5 561	4	0	4	0,00
	08/2023	£ 5 561	\$ 7 068	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023	\$ 1 303	AUD 1 971	10	0	10	0,00
UAG	07/2023	AUD 3 141	\$ 2 097	11	(4)	7	0,00
	07/2023	\$ 196	AUD 300	3	0	3	0,00
	08/2023	2 099	3 141	4	(11)	(7)	0,00
	08/2023	ZAR 12 317	\$ 642	1	(8)	(7)	0,00
	09/2023	6 658	380	30	0	30	0,01
				\$ 2 071	\$ (1 052)	\$ 1 019	0,22

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	AUD 348	\$ 228	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	07/2023	\$ 509	AUD 767	2	0	2	0,00
	08/2023	AUD 767	\$ 510	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07/2023	437	284	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	DKK 536	77	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	€ 1 281	1 400	2	0	2	0,00
	07/2023	¥ 85 765	617	23	0	23	0,01
	07/2023	KRW 4 104	3	0	0	0	0,00
	07/2023	NOK 2 048	186	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	SEK 192	18	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 3	BRL 15	0	0	0	0,00
	07/2023	143	DKK 974	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	130 129	€ 121 072	1 962	0	1 962	0,41
	08/2023	DKK 972	\$ 143	1	0	1	0,00
BPS	07/2023	BRL 0	0	0	0	0	0,00
	07/2023	CHF 93	103	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	DKK 2	0	0	0	0	0,00
	07/2023	€ 120 359	131 874	563	(1)	562	0,12
	07/2023	¥ 928 272	6 681	259	0	259	0,06
	07/2023	TWD 73 345	2 395	40	0	40	0,01
	07/2023	\$ 363	AUD 549	2	0	2	0,00
	07/2023	7 673	CHF 6 862	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	401	CNY 2 900	0	(2)	(2)	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	
	07/2023	\$	128 372	€	119 415	\$	1 910	0,41
	07/2023		46	NOK	500		0	0,00
	08/2023	AUD	549	\$	364		(2)	0,00
	08/2023	CHF	6 843		7 673		3	0,00
	08/2023	CNY	2 895		401		1	0,00
	08/2023	NOK	499		46		0	0,00
	08/2023	\$	130 715	€	119 131		(566)	(0,12)
BRC	07/2023		941	KRW	1 241 307		2	0,00
	08/2023	KRW	1 239 746	\$	941		(2)	0,00
CBK	07/2023	CAD	2 202		1 616		(48)	(0,01)
	07/2023	€	115 521		125 490		3	(0,12)
	07/2023	MXN	7 597		422		(21)	0,00
	07/2023	NOK	182		16		(1)	0,00
	07/2023	\$	1 119	BRL	5 351		(10)	0,00
	07/2023		191	ILS	691		(4)	0,00
	07/2023		442	MXN	7 597		1	0,00
	07/2023		2 361	TWD	73 569		1	0,00
	08/2023	BRL	5 351	\$	1 113		9	0,00
	08/2023	ILS	691		191		4	0,00
	08/2023	MXN	7 597		440		(1)	0,00
	08/2023	TWD	73 570		2 361		0	0,00
	08/2023	\$	115 169	€	105 782		398	0,09
CLY	07/2023	DKK	1 576	\$	228		(3)	0,00
	07/2023	\$	193	CHF	173		1	0,00
	08/2023	CHF	173	\$	193		(1)	0,00
GLM	07/2023	BRL	5 367		1 072		(41)	(0,01)
	07/2023	MYR	1 764		393		15	0,00
	07/2023	\$	286	NOK	3 082		2	0,00
	08/2023	NOK	3 079	\$	286		(2)	0,00
JPM	07/2023	€	118 969		129 903		107	0,02
	07/2023	INR	15 846		191		(2)	0,00
	07/2023	\$	193	INR	15 854		0	0,00
	07/2023		2 415	¥	345 326		(25)	(0,01)
	07/2023		47	SGD	64		0	0,00
	08/2023	INR	15 868	\$	193		0	0,00
	08/2023	¥	343 859		2 415		26	0,01
	08/2023	SGD	64		47		0	0,00
MBC	08/2023	\$	130 084	€	118 969		(11)	(0,02)
	07/2023	CAD	1	\$	1		0	0,00
	07/2023	CNY	20		3		0	0,00
	07/2023	€	3 969		4 268		(63)	(0,01)
	07/2023	£	4 119		5 099		(138)	(0,03)
	07/2023	SGD	1 233		912		2	0,00
	07/2023	\$	615	£	494		12	0,00
MYI	07/2023	ILS	690	\$	185		(1)	0,00
	07/2023	SEK	9 623		896		6	0,00
	07/2023	\$	644	CHF	583		8	0,00
	07/2023		127	DKK	868		0	0,00
	07/2023		538	IDR	8 101 622		2	0,00
	07/2023		380	MYR	1 764		(2)	0,00
	07/2023		910	SEK	9 830		0	0,00
	07/2023		945	SGD	1 277		(2)	0,00
	07/2023	ZAR	5 401	\$	275		(11)	0,00
	08/2023	DKK	867		127		0	0,00
	08/2023	IDR	8 104 686		538		(1)	0,00
	08/2023	MYR	1 764		381		2	0,00
	08/2023	SEK	9 818		910		0	0,00
	08/2023	SGD	1 275		945		1	0,00
SCX	07/2023	CHF	7 227		8 044		(35)	(0,01)
	07/2023	\$	748	AUD	1 127		2	0,00
	07/2023		1	IDR	11 432		0	0,00
	08/2023	AUD	1 127	\$	749		(2)	0,00
SOG	07/2023		2 302		1 506		(26)	(0,01)
	07/2023	HKD	21 181		2 706		3	0,00
	07/2023	\$	128 459	€	119 415		1 822	0,39
	07/2023		289	ZAR	5 408		(3)	0,00
	08/2023	ZAR	5 423	\$	289		3	0,00
TOR	07/2023	AUD	1 218		797		(14)	0,00
	07/2023	\$	916	AUD	1 387		7	0,00
	07/2023		1 665	CAD	2 203		1	0,00
	07/2023		4 607	£	3 625		2	0,00
	07/2023		4 644	¥	668 664		(17)	0,00
	08/2023	AUD	1 387	\$	917		(7)	0,00
	08/2023	CAD	2 202		1 665		1	0,00
	08/2023	£	3 625		4 608		(2)	0,00
	08/2023	¥	665 829		4 644		17	0,00
UAG	07/2023	AUD	279		183		(3)	0,00
	07/2023	CHF	471		524		(2)	0,00
	07/2023	CNY	2 887		411		13	0,00
	07/2023	IDR	8 070 857		538		0	0,00
	07/2023	KRW	1 235 012		937		(1)	0,00
	07/2023	NOK	1 495		135		(4)	0,00
	07/2023	SGD	109		81		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
	07/2023	\$ 500	AUD 756	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07/2023	189	CHF 169	0	0	0	0,00
	08/2023	AUD 756	\$ 500	0	(3)	(3)	0,00
	08/2023	CHF 168	189	0	0	0	0,00
				\$ 7 246	\$ (1 752)	\$ 5 494	1,18

Au 30 juin 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	07/2023	AUD 1	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	CNY 2	0	0	0	0	0,00
	07/2023	DKK 1	0	0	0	0	0,00
	07/2023	KRW 692	1	0	0	0	0,00
	07/2023	NOK 2	0	0	0	0	0,00
	07/2023	SEK 0	0	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 0	BRL 0	0	0	0	0,00
	07/2023	0	DKK 0	0	0	0	0,00
	07/2023	2	£ 1	0	0	0	0,00
	07/2023	1	SEK 6	0	0	0	0,00
	08/2023	DKK 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	08/2023	SEK 6	1	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	CHF 0	0	0	0	0	0,00
	07/2023	¥ 606	4	0	0	0	0,00
	07/2023	TWD 46	2	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 0	AUD 0	0	0	0	0,00
	07/2023	5	CHF 4	0	0	0	0,00
	07/2023	0	CNY 2	0	0	0	0,00
	07/2023	6	€ 6	0	0	0	0,00
	07/2023	83	£ 67	2	0	2	0,00
	07/2023	0	NOK 2	0	0	0	0,00
	08/2023	AUD 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	08/2023	CHF 4	5	0	0	0	0,00
	08/2023	CNY 2	0	0	0	0	0,00
	08/2023	€ 6	6	0	0	0	0,00
CBK	08/2023	NOK 2	0	0	0	0	0,00
	07/2023	CAD 1	1	0	0	0	0,00
	07/2023	MXN 4	0	0	0	0	0,00
	07/2023	NOK 0	0	0	0	0	0,00
	07/2023	TWD 5	0	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 1	BRL 3	0	0	0	0,00
	07/2023	0	MXN 8	0	0	0	0,00
	07/2023	2	TWD 51	0	0	0	0,00
	08/2023	BRL 3	\$ 1	0	0	0	0,00
	08/2023	MXN 8	0	0	0	0	0,00
	08/2023	TWD 51	2	0	0	0	0,00
JPM	07/2023	BRL 3	1	0	0	0	0,00
	07/2023	£ 69	87	0	0	0	0,00
	07/2023	INR 2	0	0	0	0	0,00
	07/2023	SGD 1	0	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 0	INR 2	0	0	0	0,00
	07/2023	2	¥ 226	0	0	0	0,00
	08/2023	INR 2	\$ 0	0	0	0	0,00
	08/2023	¥ 225	2	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 87	£ 69	0	0	0	0,00
MYI	07/2023	ILS 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	07/2023	MXN 4	0	0	0	0	0,00
	07/2023	SEK 6	1	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 0	DKK 0	0	0	0	0,00
	07/2023	83	£ 67	2	0	2	0,00
	07/2023	0	IDR 4 788	0	0	0	0,00
	07/2023	0	SGD 1	0	0	0	0,00
	07/2023	ZAR 5	\$ 0	0	0	0	0,00
	08/2023	DKK 0	0	0	0	0	0,00
	08/2023	IDR 4 790	0	0	0	0	0,00
	08/2023	SGD 1	0	0	0	0	0,00
RYL	07/2023	CAD 0	0	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	CHF 4	5	0	0	0	0,00
	07/2023	IDR 4 763	0	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 1	AUD 1	0	0	0	0,00
	07/2023	81	£ 65	2	0	2	0,00
	08/2023	AUD 1	\$ 1	0	0	0	0,00
SOG	07/2023	1	1	0	0	0	0,00
	07/2023	€ 6	6	0	0	0	0,00
	07/2023	HKD 12	2	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 0	ZAR 9	0	0	0	0,00
	07/2023	ZAR 4	\$ 0	0	0	0	0,00
	08/2023	9	0	0	0	0	0,00
TOR	07/2023	AUD 1	0	0	0	0	0,00
	07/2023	£ 69	88	0	0	0	0,00
	07/2023	¥ 59	0	0	0	0	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
	07/2023	\$	AUD 1	0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023		CAD 2	0	0	0	0,00
	07/2023		¥ 438	0	0	0	0,00
	08/2023	AUD	\$ 1	0	0	0	0,00
	08/2023	CAD	1	0	0	0	0,00
	08/2023	¥	436 3	0	0	0	0,00
	08/2023	\$	£ 69	0	0	0	0,00
UAG	07/2023		AUD 1	0	0	0	0,00
	07/2023		CHF 0	0	0	0	0,00
	07/2023		ILS 0	0	0	0	0,00
	08/2023	AUD	\$ 0	0	0	0	0,00
	08/2023	CHF	0	0	0	0	0,00
	08/2023	ILS	0	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ 5 932	1,28

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. 01/08/2053	\$ 10 600	\$ (8 659)	(1,87)
5,500 % éch. 01/07/2053 (i)	300	(299)	(0,07)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (8 958)	(1,94)
Total des Investissements		\$ 625 880	135,49
Autres actifs et passifs à court terme		\$ (163 944)	(35,49)
Actifs nets		\$ 461 936	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.
- (h) Titre convertible conditionnel.
- (i) Les titres vendus à découvert au 30 juin 2023 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.
- (j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2022 : 0,64 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Intelsat Emergence S.A.	19/06/2017 - 23/02/2022	\$ 5 147	\$ 1 260	0,27
Morgan Stanley 0,000 % éch. 02/04/2032	11/02/2020	613	437	0,09
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25/09/2020	278	1 313	0,28
		\$ 6 038	\$ 3 010	0,64

Un montant en numéraire de 10 060 \$ (31 décembre 2022 : 10 994 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 935 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 84 562	\$ 505 390	\$ 7 057	\$ 597 009
Fonds d'investissement	23 276	0	0	23 276
Contrats de mise en pension	0	2 001	0	2 001
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	101	12 483	(32)	12 552
Titres vendus à découvert	0	(8 958)	0	(8 958)
Totaux	\$ 107 939	\$ 510 916	\$ 7 025	\$ 625 880

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 1 849	\$ (1 360)	\$ 489	\$ (103)	\$ 0	\$ (103)
BOM	S/O	S/O	S/O	(10)	0	(10)
BPS	2 046	(1 790)	256	12	0	12
BRC	(38)	0	(38)	(125)	0	(125)
CBK	(145)	260	115	3 416	(3 380)	36
CLY	(19)	0	(19)	S/O	S/O	S/O
DUB	742	(660)	82	(14)	0	(14)
FAR	(40)	0	(40)	(25)	0	(25)
GLM	(209)	0	(209)	(221)	81	(140)
GST	(154)	261	107	(156)	191	35
HUS	9	0	9	17	0	17
JPM	S/O	S/O	S/O	67	0	67
MBC	(412)	320	(92)	2 861	(2 480)	381
MEI	(7)	0	(7)	(4)	0	(4)
MYC	(35)	94	59	(63)	94	31
MYI	(27)	(40)	(67)	(71)	(96)	(167)
RBC	617	(520)	97	21	0	21
SAL	(51)	0	(51)	(26)	0	(26)
SCX	(18)	0	(18)	3 628	(3 470)	158
SOG	1 678	(1 250)	428	(53)	0	(53)
SSB	115	0	115	11	0	11
TOR	2	0	2	S/O	S/O	S/O
UAG	29	0	29	(41)	10	(31)

⁽¹⁾ L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû par/à la contrepartie en cas de défaillance.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	72,54	59,01
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	56,63	59,05
Autres valeurs mobilières	0,08	2,47
Fonds d'investissement	5,04	5,86
Contrats de mise en pension	0,43	0,15
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,15)	0,10
Instruments financiers dérivés compensés	1,58	1,34
Instruments financiers dérivés hors cote	1,28	1,80
Titres vendus à découvert	(1,94)	(2,58)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	1,70	1,83
Obligations et billets privés	11,62	14,21
Obligations et billets municipaux	0,08	0,08
Agences du gouvernement américain	39,56	31,14
Obligations du Trésor américain	18,21	14,89
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	5,95	5,69
Titres adossés à des actifs	17,68	16,75
Émissions souveraines	3,54	4,32
Actions ordinaires	24,75	24,18
Droits	0,01	0,02
Bons de souscription	0,01	0,01
Titres privilégiés	0,56	0,42
Sociétés d'investissement immobilier	5,44	5,31
Instruments à court terme	0,14	1,68
Fonds d'investissement	5,04	5,86
Contrats de mise en pension	0,43	0,15
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,09)	0,10
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,06)	0,00
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,01
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,13	0,21
Swaps de taux d'intérêt	1,45	1,12
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,06)	(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	(0,04)	(0,02)
Swaps de rendement total sur indices	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,22	0,05
Contrats de change à terme couverts	1,18	1,91
Titres vendus à découvert	(1,94)	(2,58)
Autres actifs et passifs à court terme	(35,49)	(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				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			
AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % éch. 14/02/2024	\$ 4 400	\$ 4 230	0,10	Digital Dutch Finco BV 0,625 % éch. 15/07/2025 1,000 % éch. 15/01/2032	€ 4 600 1 000	\$ 4 565 772	0,11 0,02	MassMutual Global Funding 5,050 % éch. 07/12/2027	\$ 7 100	\$ 7 095	0,16
AIB Group PLC 2,250 % éch. 04/04/2028 2,875 % éch. 30/05/2031 7,583 % éch. 14/10/2026	€ 4 400 8 800 2 400	4 358 8 714 2 439	0,10 0,20 0,06	Digital Euro Finco LLC 2,500 % éch. 16/01/2026	6 100	6 204	0,14	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 1,412 % éch. 17/07/2025 4,636 % éch. 07/06/2031 5,719 % éch. 20/02/2026	11 200 € 1 000 \$ 6 600	10 260 1 100 6 568	0,24 0,02 0,15
alstria office REIT-AG 1,500 % éch. 23/06/2026	€ 6 000	5 276	0,12	Digital Realty Trust LP 3,600 % éch. 01/07/2029	\$ 2 900	2 579	0,06	Mizuho Financial Group, Inc. 0,849 % éch. 08/09/2024 3,752 % éch. 19/07/2023	17 100 AUD 10 400	16 927 6 920	0,39 0,16
Altarea S.C.A. 1,875 % éch. 17/01/2028	8 500	7 501	0,17	EQT AB 2,375 % éch. 06/04/2028 2,875 % éch. 06/04/2032	€ 10 000 7 400	9 625 6 445	0,22 0,15	5,414 % éch. 13/09/2028 6,201 % éch. 10/07/2024	\$ 8 800 8 600	8 737 8 600	0,20 0,20
American Honda Finance Corp. 5,000 % éch. 23/05/2025	\$ 800	797	0,02	Equitable Financial Life Global Funding 5,450 % éch. 03/03/2028	\$ 4 900	4 833	0,11	Morgan Stanley 5,050 % éch. 28/01/2027	6 000	5 952	0,14
American Tower Corp. 5,250 % éch. 15/07/2028	2 100	2 077	0,05	Banque européenne d'investissement 0,750 % éch. 15/11/2024	£ 9 700	11 528	0,27	NatWest Group PLC 0,750 % éch. 15/11/2025 0,780 % éch. 26/02/2030	€ 15 000 10 000	15 505 8 708	0,36 0,20
Assicurazioni Generali SpA 2,429 % éch. 14/07/2031	€ 1 800	1 633	0,04	Fédération des Caisses Desjardins du Québec 4,400 % éch. 23/08/2025 5,700 % éch. 14/03/2028	\$ 11 000 6 600	10 631 6 595	0,25 0,15	NE Property BV 1,875 % éch. 09/10/2026 3,375 % éch. 14/07/2027 (h)	10 700 5 800	10 139 5 686	0,23 0,13
Aviation Capital Group LLC 4,125 % éch. 01/08/2025 6,250 % éch. 15/04/2028	\$ 9 080 100	8 486 100	0,20 0,00	Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % éch. 19/07/2024 2,748 % éch. 14/06/2024	€ 7 600 € 4 600	8 027 5 597	0,19 0,13	New Immo Holding S.A. 2,750 % éch. 26/11/2026 (h)	8 800	8 610	0,20
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % éch. 16/06/2028	€ 6 300	5 773	0,13	G City Europe Ltd. 4,250 % éch. 11/09/2025	€ 11 600	11 073	0,26	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 3,875 % éch. 21/09/2023	\$ 3 500	3 481	0,08
Bank of America Corp. 1,197 % éch. 24/10/2026	\$ 15 000	13 503	0,31	Gaci First Investment Co. 5,125 % éch. 03/02/2053	\$ 9 600	8 652	0,20	Nomura Holdings, Inc. 2,172 % éch. 14/07/2028 2,679 % éch. 16/07/2030	800 7 300	676 5 979	0,02 0,14
Bank of Ireland Group PLC 0,375 % éch. 10/05/2027	€ 12 300	11 829	0,27	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % éch. 29/07/2026	€ 7 100	5 839	0,13	5,709 % éch. 09/01/2026 5,842 % éch. 18/01/2028 6,181 % éch. 18/01/2033	8 300 7 500 4 100	8 230 7 521 4 234	0,19 0,17 0,10
Bank of Montreal 5,203 % éch. 01/02/2028	\$ 5 400	5 401	0,12	GLP Capital LP 4,000 % éch. 15/01/2030 5,300 % éch. 15/01/2029	\$ 2 600 2 000	2 256 1 906	0,05 0,04	NTT Finance Corp. 4,239 % éch. 25/07/2025	2 700	2 628	0,06
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 6,210 % éch. 20/07/2023	3 300	3 301	0,08	Goodman HK Finance 4,375 % éch. 19/06/2024	5 045	4 954	0,11	OneMain Finance Corp. 6,875 % éch. 15/03/2025	800	793	0,02
Barclays PLC 1,700 % éch. 03/11/2026 2,852 % éch. 07/05/2026	£ 5 400 \$ 2 400	6 033 2 249	0,14 0,05	Goodman U.S. Finance Four LLC 4,500 % éch. 15/10/2037	6 900	5 764	0,13	Piper Sandler Cos. 5,200 % éch. 15/10/2023	8 500	8 479	0,20
BGC Partners, Inc. 3,750 % éch. 01/10/2024 8,000 % éch. 25/05/2028	1 195 4 200	1 129 4 062	0,03 0,09	GSPA Monetization Trust 6,422 % éch. 09/10/2029	9 954	9 523	0,22	Prologis International Funding S.A. 1,625 % éch. 17/06/2032	€ 1 000	834	0,02
BNP Paribas S.A. 2,219 % éch. 09/06/2026	10 500	9 716	0,22	Host Hotels & Resorts LP 4,500 % éch. 01/02/2026	7 800	7 567	0,17	Reliance Standard Life Global Funding 3,850 % éch. 19/09/2023	\$ 6 950	6 908	0,16
CaixaBank S.A. 0,750 % éch. 26/05/2028	€ 2 100	1 971	0,05	HSBC Holdings PLC 7,390 % éch. 03/11/2028	6 300	6 655	0,15	Royal Bank of Canada 4,900 % éch. 12/01/2028	4 700	4 640	0,11
Castellum AB 0,750 % éch. 04/09/2026 (h) 2,125 % éch. 20/11/2023	9 700 4 500	8 718 4 836	0,20 0,11	HSBC USA, Inc. 5,625 % éch. 17/03/2025	8 100	8 069	0,19	Sagax AB 1,125 % éch. 30/01/2027	€ 11 700	10 773	0,25
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % éch. 27/01/2028 0,900 % éch. 12/10/2029	13 300 7 600	11 478 6 071	0,26 0,14	Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,835 % éch. 13/12/2027	3 300	3 083	0,07	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,000 % éch. 12/08/2027 (h) 1,125 % éch. 04/09/2026 (h)	7 350 5 000	5 220 3 838	0,12 0,09
Citigroup, Inc. 1,250 % éch. 06/07/2026 3,070 % éch. 24/02/2028	5 000 \$ 7 400	5 106 6 814	0,12 0,16	ING Groep NV 1,125 % éch. 07/12/2028 2,125 % éch. 23/05/2026	£ 9 100 € 4 200	9 083 4 371	0,21 0,10	Santander UK Group Holdings PLC 2,421 % éch. 17/01/2029	£ 800	828	0,02
Citycon Treasury BV 1,625 % éch. 12/03/2028	€ 15 000	11 962	0,28	Association internationale de développement 0,750 % éch. 21/09/2028 1,750 % éch. 05/05/2037	£ 11 000 € 11 100	11 138 10 238	0,26 0,24	SBB Treasury Oyj 1,125 % éch. 26/11/2029	€ 1 000	641	0,01
Clarion Funding PLC 1,250 % éch. 13/11/2032	£ 2 400	2 072	0,05	Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % éch. 16/03/2028	10 200	9 497	0,22	Société Générale S.A. 1,488 % éch. 14/12/2026 4,677 % éch. 15/06/2027 6,446 % éch. 10/01/2029	\$ 14 100 6 700 700	12 416 6 461 702	0,29 0,15 0,02
Cooperative Rabobank UA 4,655 % éch. 22/08/2028	\$ 10 500	10 058	0,23	Jackson National Life Global Funding 6,242 % éch. 28/06/2024	\$ 6 600	6 609	0,15	Standard Chartered PLC 0,800 % éch. 17/11/2029 1,456 % éch. 14/01/2027 7,776 % éch. 16/11/2025	€ 3 600 \$ 15 800 1 700	3 212 14 018 1 740	0,07 0,32 0,04
Corebridge Global Funding 5,750 % éch. 02/07/2026 (b)	2 500	2 493	0,06	JPMorgan Chase & Co. 4,851 % éch. 25/07/2028	9 700	9 576	0,22	Starwood Property Trust, Inc. 3,750 % éch. 31/12/2024 4,375 % éch. 15/01/2027	1 200 800	1 126 690	0,03 0,02
CPI Property Group S.A. 1,750 % éch. 14/01/2030 2,750 % éch. 12/05/2026 2,750 % éch. 22/01/2028	€ 6 100 27 100 £ 400	4 039 24 066 341	0,09 0,56 0,01	KBC Group NV 0,250 % éch. 01/03/2027 0,375 % éch. 16/06/2027	€ 3 000 3 200	2 931 3 119	0,07 0,07	Stifel Financial Corp. 4,000 % éch. 15/05/2030	12 900	11 025	0,25
CTP NV 0,500 % éch. 21/06/2025 0,875 % éch. 20/01/2026 1,500 % éch. 27/09/2031	€ 1 400 10 200 4 700	1 362 9 502 3 579	0,03 0,22 0,08	Kookmin Bank 4,500 % éch. 01/02/2029 (g)	\$ 7 400	6 951	0,16	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,520 % éch. 13/01/2028	5 200	5 225	0,12
Deutsche Bank AG 1,000 % éch. 19/11/2025 1,625 % éch. 20/01/2027 1,750 % éch. 19/11/2030 1,875 % éch. 23/02/2028 2,625 % éch. 16/12/2024 3,961 % éch. 26/11/2025	600 7 400 14 200 4 000 € 9 000 \$ 6 800	618 7 180 12 260 3 867 10 650 6 487	0,01 0,17 0,28 0,09 0,25 0,15	LeasePlan Corp. NV 0,250 % éch. 23/02/2026	€ 15 000	14 678	0,34	Tesco Property Finance PLC 5,744 % éch. 13/04/2040	£ 4 236	4 999	0,12
				Lendlease Finance Ltd. 3,400 % éch. 27/10/2027 3,700 % éch. 31/03/2031	AUD 24 900 4 800	14 552 2 496	0,34 0,06	Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026	€ 5 600	6 101	0,14
				Lloyds Banking Group PLC 4,375 % éch. 22/03/2028	\$ 1 200	1 139	0,03	Toyota Motor Credit Corp. 5,810 % éch. 11/12/2023	\$ 5 500	5 507	0,13
				Logicor Financing SARL 1,625 % éch. 15/07/2027 2,000 % éch. 17/01/2034 2,250 % éch. 13/05/2025 3,250 % éch. 13/11/2028	€ 1 100 11 600 2 000 12 600	998 8 420 2 031 11 770	0,02 0,19 0,05 0,27	TP ICAP Finance PLC 7,875 % éch. 17/04/2030	£ 9 800	11 820	0,27
								UBS AG 5,125 % éch. 15/05/2024 (g)	\$ 21 200	20 876	0,48
								UBS Group AG 3,750 % éch. 26/03/2025	3 070	2 940	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
Billets University of California Revenue Notes, Series 2020	\$ 5 500	\$ 5 094	0,12	5,328 % éch. 20/09/2065	1 156	1 148	0,03	0,500 % éch. 15/04/2024	\$ 10 343	\$ 10 093	0,23
0,883 % éch. 15/05/2025				5,566 % éch. 20/01/2072	\$ 4 292	\$ 4 184	0,10	0,625 % éch. 15/01/2024	69 936	68 754	1,59
				5,614 % éch. 20/08/2062	745	741	0,02	0,625 % éch. 15/07/2032	16 285	14 977	0,35
		22 695	0,53	5,616 % éch. 20/06/2072	2 992	2 989	0,07	0,625 % éch. 15/02/2043	132	108	0,00
				5,694 % éch. 20/08/2065	3 858	3 820	0,09	0,750 % éch. 15/02/2045	25 632	21 206	0,49
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				5,816 % éch. 20/10/2072	7 015	6 977	0,16	0,875 % éch. 15/02/2047	8 167	6 860	0,16
Fannie Mae				5,866 % éch. 20/01/2073	7 700	7 623	0,18	1,000 % éch. 15/02/2046	768	667	0,02
3,150 % éch. 01/08/2027	946	894	0,02	5,936 % éch. 20/01/2073	13 617	13 527	0,31	1,000 % éch. 15/02/2049	2 652	2 283	0,05
3,511 % éch. 01/12/2034	24	23	0,00	5,946 % éch. 20/02/2073	17 565	17 470	0,40	1,250 % éch. 15/04/2028 (i)	13 955	13 508	0,31
3,522 % éch. 01/11/2035	27	26	0,00	5,966 % éch. 20/01/2073	26 641	26 532	0,61	1,375 % éch. 15/02/2044	781	736	0,02
3,906 % éch. 01/09/2035	7	7	0,00	6,000 % éch. 20/09/2038	3	3	0,00	1,500 % éch. 15/02/2053	9 285	9 024	0,21
3,913 % éch. 01/09/2035	48	47	0,00	6,086 % éch. 20/12/2072	5 153	5 166	0,12	Billets du Trésor américain			
3,951 % éch. 01/09/2034	8	8	0,00	6,206 % éch. 20/11/2072	9 969	10 062	0,23	1,750 % éch. 30/06/2024	16 700	16 108	0,37
3,956 % éch. 01/09/2035	13	13	0,00	8,000 % éch. 20/05/2031	5	5	0,00				
4,082 % éch. 25/05/2035	25	25	0,00	Ginnie Mae, TBA						818 712	18,92
4,204 % éch. 01/11/2025	0	0	0,00	2,000 % éch. 01/08/2053	5 500	4 627	0,11				
4,246 % éch. 01/03/2036	9	9	0,00	4,000 % éch. 01/07/2053	11 300	10 779	0,25	TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
4,287 % éch. 01/04/2033	6	5	0,00	5,000 % éch. 01/07/2053	13 000	12 845	0,30	American Home Mortgage Investment Trust			
4,323 % éch. 01/03/2036	9	8	0,00	Administration des petites entreprises				5,510 % éch. 25/12/2046	123	104	0,00
4,325 % éch. 01/09/2039	12	11	0,00	5,870 % éch. 01/07/2028	7	7	0,00	Angel Oak Mortgage Trust			
4,345 % éch. 01/05/2038	2 534	2 571	0,06	6,220 % éch. 01/12/2028	389	388	0,01	1,469 % éch. 25/06/2065	1 062	978	0,02
4,393 % éch. 01/01/2036	9	8	0,00	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				Ashford Hospitality Trust			
4,415 % éch. 01/11/2034	27	27	0,00	3,000 % éch. 01/03/2028 - 01/07/2052	159 884	141 002	3,26	6,319 % éch. 15/06/2035	10 151	9 889	0,23
4,521 % éch. 01/06/2035	208	211	0,00	3,500 % éch. 01/01/2047 - 01/08/2052	17 407	15 901	0,37	Atrium Hotel Portfolio Trust			
4,812 % éch. 25/12/2042	55	52	0,00	4,000 % éch. 01/04/2024 - 01/10/2052	27 826	26 686	0,62	6,393 % éch. 15/06/2035	6 900	6 751	0,16
4,862 % éch. 01/07/2035	7	7	0,00	4,500 % éch. 01/07/2023 - 01/05/2053	16 922	16 314	0,38	Banc of America Funding Trust			
4,944 % éch. 01/10/2044	13	12	0,00	5,000 % éch. 01/10/2031 - 01/06/2053	165 311	162 086	3,75	3,616 % éch. 20/09/2035 ^	837	659	0,02
5,000 % éch. 25/04/2033 - 25/06/2043	144	141	0,00	5,500 % éch. 01/08/2023 - 01/01/2040	2 868	2 917	0,07	4,381 % éch. 25/05/2035	1 329	1 237	0,03
5,036 % éch. 25/07/2037	186	181	0,00	6,000 % éch. 01/05/2024 - 01/02/2041	1 373	1 413	0,03	Banc of America Merrill Lynch Trust			
5,094 % éch. 25/06/2034	263	259	0,01	6,500 % éch. 01/07/2034 - 01/03/2037	66	68	0,00	3,218 % éch. 14/04/2033	5 500	5 112	0,12
5,095 % éch. 01/07/2035	11	11	0,00	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc.			
5,144 % éch. 01/10/2040	8	8	0,00	3,000 % éch. 01/07/2053	429 888	378 870	8,77	4,231 % éch. 15/09/2060	10 900	10 285	0,24
5,258 % éch. 25/03/2034	3	3	0,00	3,500 % éch. 01/08/2053	400 500	365 378	8,45	Banc of America Mortgage Trust			
5,348 % éch. 01/09/2034	107	108	0,00	4,500 % éch. 01/08/2053	232 600	218 490	5,05	4,370 % éch. 25/07/2035 ^	197	181	0,00
5,500 % éch. 25/09/2042	400	395	0,01	4,500 % éch. 01/07/2038 - 01/08/2053	189 100	181 907	4,20	5,268 % éch. 25/07/2034	146	131	0,00
5,524 % éch. 25/12/2036	38	37	0,00	5,000 % éch. 01/07/2053	279 300	273 732	6,33	BankUnited Trust			
5,681 % éch. 01/05/2037	85	83	0,00	5,500 % éch. 01/08/2053	126 400	125 778	2,91	5,750 % éch. 25/09/2045	747	680	0,02
5,700 % éch. 25/09/2041	1 426	1 405	0,03	Obligations du Trésor américain				Barclays Commercial Mortgage Securities Trust			
5,900 % éch. 25/07/2042	33	33	0,00	1,375 % éch. 15/11/2040	163 600	109 586	2,53	4,314 % éch. 15/12/2051	8 000	7 540	0,17
6,050 % éch. 25/04/2032	8	8	0,00	1,375 % éch. 15/08/2050	24 100	14 018	0,32	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
				1,625 % éch. 15/11/2050	35 800	22 253	0,51	2,785 % éch. 25/11/2030	2	2	0,00
				1,750 % éch. 15/08/2041	19 500	13 714	0,32	3,709 % éch. 25/04/2034	197	165	0,00
				1,875 % éch. 15/02/2041	2 400	1 745	0,04	3,766 % éch. 25/04/2034	174	156	0,00
				2,000 % éch. 15/02/2050	21 700	14 888	0,34	4,027 % éch. 25/04/2034	89	82	0,00
				2,250 % éch. 15/08/2049	6 400	4 654	0,11	4,201 % éch. 25/01/2034	151	147	0,00
				2,500 % éch. 15/02/2045	6 100	4 726	0,10	4,439 % éch. 25/02/2034	63	58	0,00
				2,875 % éch. 15/08/2045	5 200	4 294	0,11	4,513 % éch. 25/04/2033	12	12	0,00
				2,875 % éch. 15/05/2049	7 500	6 205	0,14	4,752 % éch. 25/07/2034	6	5	0,00
				3,000 % éch. 15/05/2042	2 900	2 494	0,06	5,552 % éch. 25/12/2035	83	80	0,00
				3,000 % éch. 15/11/2044	138 800	117 538	2,72	Bear Stearns ALT-A Trust			
				3,000 % éch. 15/02/2049	8 100	6 855	0,16	4,195 % éch. 25/05/2035	377	356	0,01
				3,125 % éch. 15/11/2041	15 300	13 482	0,31	4,202 % éch. 25/09/2035 ^	413	257	0,01
				3,125 % éch. 15/02/2043	5 600	4 887	0,11	5,470 % éch. 25/02/2034	43	38	0,00
				3,125 % éch. 15/08/2044	23 500	20 348	0,47	Benchmark Mortgage Trust			
				3,250 % éch. 15/05/2042	22 800	20 357	0,47	3,666 % éch. 15/01/2051	11 100	10 158	0,23
				3,375 % éch. 15/08/2042	30 400	27 608	0,64	3,965 % éch. 10/04/2051	6 084	5 788	0,13
				3,375 % éch. 15/05/2044	47 300	42 670	0,99	Citigroup Commercial Mortgage Trust			
				3,625 % éch. 15/02/2044	24 700	23 155	0,53	3,251 % éch. 10/05/2035	8 002	7 435	0,17
				3,750 % éch. 15/08/2041	18 600	17 975	0,42	Citigroup Mortgage Loan Trust			
				3,750 % éch. 15/11/2043	5 000	4 781	0,11	3,974 % éch. 25/09/2037 ^	96	84	0,00
				3,875 % éch. 15/05/2043	12 400	12 102	0,28	5,410 % éch. 25/10/2035	34	31	0,00
				4,000 % éch. 15/11/2042	13 425	13 345	0,31	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
				4,000 % éch. 15/11/2052	43 900	45 107	1,04	6,080 % éch. 25/09/2035	899	904	0,02
				4,375 % éch. 15/11/2039	10 100	10 705	0,25	Commercial Mortgage Trust			
				Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)				3,144 % éch. 10/03/2048	3 277	3 197	0,07
				0,125 % éch. 15/10/2024	40 077	38 661	0,89	3,545 % éch. 10/02/2036	11 300	10 270	0,24
				0,125 % éch. 15/07/2031	17 994	15 964	0,37	3,590 % éch. 10/11/2047	12 200	11 734	0,27
				0,125 % éch. 15/01/2032	13 896	12 240	0,28	Countrywide Alternative Loan Trust			
				0,125 % éch. 15/02/2051	3 612	2 413	0,06	5,500 % éch. 25/02/2036	2 934	2 332	0,05
				0,250 % éch. 15/02/2050	8 022	5 618	0,13	5,000 % éch. 25/02/2036 ^	1 871	1 561	0,04
								5,750 % éch. 25/02/2037	3 271	1 815	0,04
								6,000 % éch. 25/02/2036	4 773	2 995	0,07
								6,000 % éch. 25/04/2036 ^	193	100	0,00
								6,000 % éch. 25/08/2036 ^	5 142	3 184	0,07
								6,000 % éch. 25/08/2036	842	778	0,02
								6,000 % éch. 25/11/2036 ^	260	144	0,00
								6,000 % éch. 25/08/2037 ^	3 855	2 335	0,05
								6,610 % éch. 25/11/2035	6 881	6 321	0,15

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
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Mortgage Equity Conversion Asset Trust				5,790 % éch. 25/01/2045	\$ 1 603	\$ 1 524	0,04
3,810 % éch. 25/11/2034	373	339	0,01	5,790 % éch. 25/05/2042	\$ 3 756	\$ 3 511	0,08	Warwick Finance Residential Mortgages PLC			
3,833 % éch. 20/10/2035	1 420	1 366	0,03	MortgageIT Trust				0,000 % éch. 21/12/2049 (c)	£ 0	1 651	0,04
3,864 % éch. 20/02/2035	92	92	0,00	5,710 % éch. 25/10/2035	650	635	0,01	5,865 % éch. 21/12/2049	9 369	11 855	0,27
4,125 % éch. 19/07/2031	0	0	0,00	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust				6,564 % éch. 21/12/2049	2 030	2 596	0,06
5,550 % éch. 25/04/2046	809	758	0,02	7,000 % éch. 25/10/2034 ^	447	398	0,01	7,064 % éch. 21/12/2049	1 015	1 271	0,03
5,910 % éch. 20/02/2036 ^	50	42	0,00	7,500 % éch. 25/03/2034 ^	578	507	0,01	7,564 % éch. 21/12/2049	580	724	0,02
6,000 % éch. 25/07/2037 ^	250	124	0,00	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				8,064 % éch. 21/12/2049	580	712	0,02
6,000 % éch. 25/07/2037 ^	250	124	0,00	6,500 % éch. 25/02/2035 ^	1 898	1 701	0,04	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				New Residential Mortgage Loan Trust				5,500 % éch. 25/05/2035 ^	\$ 540	426	0,01
4,237 % éch. 25/01/2034 ^	15	12	0,00	3,500 % éch. 25/12/2057	5 717	5 361	0,12	6,000 % éch. 25/11/2035 ^	470	383	0,01
5,490 % éch. 25/06/2035	118	108	0,00	Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,500 % éch. 25/11/2034 ^	24	22	0,00	6,220 % éch. 25/02/2035	416	409	0,01	3,770 % éch. 25/02/2031	1	1	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				Paragon Mortgages PLC							
4,311 % éch. 25/06/2033	3	3	0,00	3,563 % éch. 15/11/2038	€ 573	605	0,01				
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				Precise Mortgage Funding PLC							
6,000 % éch. 25/11/2035 ^	2 322	673	0,02	0,000 % éch. 12/12/2055 (c)	£ 0	1 991	0,05				
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				Prime Mortgage Trust							
3,387 % éch. 26/04/2038	733	708	0,02	5,550 % éch. 25/02/2034	\$ 65	60	0,00				
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				Primrose Residential DAC							
5,750 % éch. 25/04/2036 ^	762	424	0,01	4,189 % éch. 24/03/2061	€ 12 699	13 761	0,32	Ameriquest Mortgage Securities Trust			
6,000 % éch. 25/05/2036 ^	1 869	1 101	0,03	Residential Accredited Loans, Inc. Trust				5,735 % éch. 25/03/2036	50	50	0,00
6,000 % éch. 25/04/2037 ^	562	222	0,01	5,550 % éch. 25/05/2037 ^	\$ 2 429	1 711	0,04	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
CSAIL Commercial Mortgage Trust				6,000 % éch. 25/04/2036	2 576	2 071	0,05	5,855 % éch. 25/01/2036	1 139	1 133	0,03
3,458 % éch. 15/11/2050	4 600	4 150	0,10	Residential Asset Securitization Trust				6,080 % éch. 25/05/2035	3 517	3 452	0,08
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				6,000 % éch. 25/01/2037 ^	2 511	906	0,02	6,170 % éch. 25/10/2034	1 135	1 119	0,03
5,480 % éch. 25/08/2037 ^	2 519	2 137	0,05	6,500 % éch. 25/09/2036 ^	706	253	0,01	6,260 % éch. 25/03/2035	4 705	4 582	0,11
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				Armada Euro CLO DAC			
5,235 % éch. 19/07/2044	10	9	0,00	5,398 % éch. 25/02/2036 ^	122	100	0,00	3,897 % éch. 15/07/2031	€ 11 995	12 802	0,30
Eurohome UK Mortgages PLC				Resloc UK PLC				Asset-Backed Funding Certificates Trust			
5,137 % éch. 15/06/2044	£ 1 732	2 116	0,05	5,161 % éch. 15/12/2043	£ 3 635	4 451	0,10	5,850 % éch. 25/06/2034	\$ 92	90	0,00
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				Ripon Mortgages PLC				Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
5,376 % éch. 25/10/2034	\$ 81	78	0,00	5,491 % éch. 28/08/2056	13 463	17 051	0,39	3,688 % éch. 25/12/2036	2 231	2 148	0,05
6,000 % éch. 25/06/2037	1 139	446	0,01	RMAC Securities PLC				Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
GS Mortgage Securities Corp. Trust				5,414 % éch. 12/06/2044	768	919	0,02	6,410 % éch. 16/01/2030	11 252	11 198	0,26
6,110 % éch. 15/07/2025	3 810	3 756	0,09	Stratton Mortgage Funding PLC				Avoca CLO DAC			
GSR Mortgage Loan Trust				5,391 % éch. 20/07/2060	15 165	19 281	0,45	3,867 % éch. 15/07/2030	€ 11 476	12 315	0,28
3,935 % éch. 25/01/2036 ^	1 286	1 259	0,03	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				3,997 % éch. 15/10/2032	5 200	5 546	0,13
4,070 % éch. 25/09/2035	1 513	1 432	0,03	3,392 % éch. 25/02/2036 ^	\$ 1 013	921	0,02	Barings CLO Ltd.			
4,234 % éch. 25/06/2034	53	50	0,00	5,133 % éch. 25/04/2034	1 330	1 311	0,03	6,210 % éch. 15/04/2031	\$ 13 100	12 937	0,30
4,485 % éch. 25/06/2034	23	20	0,00	5,227 % éch. 25/09/2034	227	213	0,00	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
5,500 % éch. 25/01/2037 ^	10	19	0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust				4,807 % éch. 25/05/2035	119	119	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				5,370 % éch. 25/09/2047	10 478	8 774	0,20	4,842 % éch. 25/12/2035	1 114	1 101	0,03
5,417 % éch. 19/03/2037	3 172	2 853	0,07	5,626 % éch. 19/04/2035	264	239	0,01	6,350 % éch. 25/01/2045	124	122	0,00
5,597 % éch. 19/05/2035	159	146	0,00	5,646 % éch. 19/07/2035	184	176	0,00	Black Diamond CLO DAC			
IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust				5,710 % éch. 25/02/2036 ^	432	364	0,01	4,303 % éch. 15/05/2032	€ 12 000	12 809	0,30
3,544 % éch. 25/01/2032	0	0	0,00	5,726 % éch. 19/05/2034	165	150	0,00	Blackrock European CLO DAC			
IndyMac Mortgage Loan Trust				5,806 % éch. 19/09/2032	18	18	0,00	3,797 % éch. 15/10/2031	13 000	13 858	0,32
5,630 % éch. 25/06/2037	1 008	902	0,02	6,000 % éch. 25/05/2047	7 411	6 071	0,14	BlueMountain CLO Ltd.			
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				6,453 % éch. 22/10/2030	\$ 962	957	0,02
3,358 % éch. 15/11/2048	9 403	9 028	0,21	7,500 % éch. 25/10/2036 ^	648	390	0,01	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust				Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				3,827 % éch. 15/07/2030	€ 1 797	1 925	0,04
2,994 % éch. 15/12/2049	8 260	7 757	0,18	6,639 % éch. 25/06/2033	2	2	0,00	BNPP AM Euro CLO DAC			
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				Thornburg Mortgage Securities Trust				4,031 % éch. 22/07/2032	12 000	12 793	0,30
6,403 % éch. 15/06/2035	10 951	10 173	0,23	3,114 % éch. 25/09/2037	2 622	2 541	0,06	Bosphorus CLO DAC			
JP Morgan Mortgage Trust				7,151 % éch. 25/06/2047 ^	1 954	1 651	0,04	4,346 % éch. 15/12/2030	240	258	0,01
4,186 % éch. 25/07/2035	123	115	0,00	Towd Point Mortgage Funding PLC				Bridgepoint CLO DAC			
5,750 % éch. 25/01/2036 ^	336	166	0,00	5,635 % éch. 20/10/2051	£ 10 086	12 841	0,30	4,387 % éch. 15/01/2034	1 000	1 076	0,03
Landmark Mortgage Securities PLC				5,841 % éch. 20/07/2045	18 688	23 761	0,55	Cairn CLO DAC			
4,865 % éch. 17/04/2044	£ 6 712	8 258	0,19	Tower Bridge Funding PLC				3,842 % éch. 30/04/2031	12 813	13 699	0,32
Lehman XS Trust				5,527 % éch. 20/11/2063	5 687	7 191	0,17	4,212 % éch. 20/10/2028	107	116	0,00
5,510 % éch. 25/12/2036	\$ 3 911	3 793	0,09	Trinity Square PLC				Carlyle Euro CLO DAC			
5,550 % éch. 25/03/2047	10 696	9 156	0,21	5,316 % éch. 15/07/2059	10 514	13 341	0,31	3,953 % éch. 15/08/2030	8 829	9 417	0,22
London Wall Mortgage Capital PLC				Tudor Rose Mortgages				Carrington Mortgage Loan Trust			
5,502 % éch. 15/05/2052	£ 1 357	1 712	0,04	5,509 % éch. 20/06/2048	523	661	0,02	6,140 % éch. 25/06/2035	\$ 847	825	0,02
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				Twin Bridges PLC				CIFC Funding Ltd.			
3,857 % éch. 25/01/2036	\$ 9	8	0,00	6,115 % éch. 12/12/2054	2 904	3 691	0,09	6,440 % éch. 16/11/2030	1 320	1 315	0,03
4,560 % éch. 21/11/2034	1 693	1 601	0,04	Uropa Securities PLC				CIT Mortgage Loan Trust			
MASTR Reperforming Loan Trust				4,729 % éch. 10/10/2040	526	653	0,02	6,500 % éch. 25/10/2037	759	758	0,02
7,000 % éch. 25/05/2035	533	385	0,01	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Citigroup Mortgage Loan Trust			
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				3,307 % éch. 25/01/2037 ^	\$ 3 873	3 401	0,08	5,470 % éch. 25/09/2036	4 533	3 312	0,08
4,159 % éch. 25/02/2035	691	652	0,02	3,715 % éch. 25/09/2036 ^	1 023	908	0,02	Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
4,391 % éch. 25/06/2035	293	277	0,01	3,753 % éch. 25/02/2037 ^	645	590	0,01	5,400 % éch. 25/03/2037	1 839	1 517	0,04
5,650 % éch. 25/11/2035	220	207	0,00	5,690 % éch. 25/07/2045	319	303	0,01	Commonbond Student Loan Trust			
MetLife Securitization Trust				5,730 % éch. 25/10/2045	3 107	2 935	0,07	6,000 % éch. 25/05/2041	546	537	0,01
3,750 % éch. 25/03/2057	6 326	5 928	0,14	5,770 % éch. 25/01/2045	131	129	0,00				

TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS

ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				5,270 % éch. 25/10/2036	229	87	0,00
5,470 % éch. 25/08/2036 ^	6 265	1 594	0,04				
Ameriquest Mortgage Securities Trust				5,735 % éch. 25/03/2036	50	50	0,00
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				5,855 % éch. 25/01/2036	1 139	1 133	0,03
5,855 % éch. 25/01/2036	1 139	1 133	0,03	6,080 % éch. 25/05/2035	3 517	3 452	0,08
6,170 % éch. 25/10/2034	1 135	1 119	0,03	6,260 % éch. 25/03/2035	4 705	4 582	0,11
Armada Euro CLO DAC				3,897 % éch. 15/07/2031	€ 11 995	12 802	0,30
Asset-Backed Funding Certificates Trust				5,850 % éch. 25/06/2034	\$ 92	90	0,00
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				3,688 % éch. 25/12/2036	2 231	2 148	0,05
6,410 % éch. 16/01/2030	11 252	11 198	0,26				
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				3,997 % éch. 15/10/2032	5 200	5 546	0,13
Avoca CLO DAC				6,210 % éch. 15/04/2031	\$ 13 100	12 937	0,30
3,867 % éch. 15/07/2030	€ 11 476	12 315	0,28				
3,997 % éch. 15/10/2032	5 200	5 546	0,13				
Barings CLO Ltd.				4,807 % éch. 25/05/2035	119	119	0,00
6,210 % éch. 15/04/2031	\$ 13 100	12 937	0,30				
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust							

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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 Asset-Backed Certificates Trust				5,450 % éch. 25/07/2036	7 716	\$ 2 960	0,07	Japan Finance Organization for Municipalities			
5,290 % éch. 25/06/2047 ^	\$ 1 677	\$ 1 495	0,03	5,470 % éch. 25/09/2036	7 694	3 443	0,08	0,010 % éch. 02/02/2028	9 900	\$ 9 195	0,21
5,370 % éch. 25/09/2037 ^	1 148	1 152	0,03	5,855 % éch. 25/01/2035	1 476	1 391	0,03	Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap			
5,380 % éch. 25/07/2037 ^	1 000	834	0,02	New Century Home Equity Loan Trust				0,875 % éch. 21/03/2046	10 000	6 363	0,15
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				5,510 % éch. 25/05/2036	47	46	0,00	Obligation internationale du gouvernement paraguayen			
6,005 % éch. 25/08/2034	190	189	0,00	5,870 % éch. 25/10/2035	3 668	3 505	0,08	4,950 % éch. 28/04/2031	2 300	2 215	0,05
6,050 % éch. 25/10/2034	844	814	0,02	OZLM Ltd.				Obligation internationale du gouvernement péruvien			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				6,340 % éch. 17/04/2031	10 246	10 105	0,23	6,350 % éch. 12/08/2028 PE	25 000	6 998	0,16
5,448 % éch. 25/05/2046	1 716	1 454	0,03	6,549 % éch. 30/10/2030	8 671	8 639	0,20	Obligation internationale du gouvernement polonais			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				Palmer Square European Loan Funding DAC				5,500 % éch. 04/04/2053	4 000	4 036	0,09
5,270 % éch. 25/11/2036	116	55	0,00	3,897 % éch. 15/10/2031	10 977	11 737	0,27	Province de l'Ontario			
CVC Cordatus Loan Fund DAC				Palmerston Park CLO DAC				1,850 % éch. 01/02/2027 CA	7 000	4 878	0,11
4,156 % éch. 15/09/2031	€ 12 997	13 876	0,32	3,825 % éch. 18/04/2030	5 565	5 993	0,14	Obligation internationale du gouvernement roumain			
FBR Securitization Trust				Purple Finance CLO DAC				3,000 % éch. 27/02/2027	12 000	10 892	0,25
5,855 % éch. 25/11/2035	\$ 4 533	4 413	0,10	4,061 % éch. 25/01/2031	731	790	0,02	Bon du Trésor britannique			
First Franklin Mortgage Loan Trust				Renaissance Home Equity Loan Trust				0,875 % éch. 31/07/2033	1 300	1 185	0,03
5,260 % éch. 25/12/2037	4 022	3 773	0,09	6,350 % éch. 25/11/2034	153	126	0,00				
5,825 % éch. 25/03/2034	365	350	0,01	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust							
6,080 % éch. 25/07/2034	82	81	0,00	5,390 % éch. 25/11/2036	5 865	1 708	0,04				
6,425 % éch. 25/07/2034	586	570	0,01	5,430 % éch. 25/05/2036	440	237	0,01				
GE-WMC Mortgage Securities Trust				Starwood Commercial Mortgage Trust							
5,230 % éch. 25/08/2036	34	14	0,00	6,296 % éch. 15/07/2038	7 449	7 386	0,17				
Griffith Park CLO DAC				Structured Asset Investment Loan Trust							
4,103 % éch. 21/11/2031	€ 12 000	12 845	0,30	5,530 % éch. 25/03/2036	529	512	0,01				
GSAMP Trust				5,915 % éch. 25/08/2035	480	455	0,01				
5,290 % éch. 25/12/2036	\$ 12 064	6 527	0,15	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust							
5,390 % éch. 25/01/2037	416	243	0,01	5,305 % éch. 25/09/2036	7 194	4 524	0,10				
Harvest CLO DAC				Venture CLO Ltd.							
4,027 % éch. 15/01/2032	€ 13 700	14 626	0,34	6,350 % éch. 20/01/2029	16 485	16 370	0,38				
Home Equity Asset Trust				WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust							
5,750 % éch. 25/07/2036	\$ 4 678	4 246	0,10	5,510 % éch. 25/04/2037	4 948	1 888	0,04				
6,185 % éch. 25/08/2035	133	129	0,00	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust							
HSI Asset Securitization Corp. Trust				6,150 % éch. 25/10/2034	1 054	1 035	0,02				
5,690 % éch. 25/12/2035	1 475	1 456	0,03								
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust											
5,585 % éch. 25/05/2036	3 873	3 632	0,08								
Jubilee CLO DAC											
3,787 % éch. 15/04/2030	€ 20 000	21 382	0,49								
LCM LP											
6,290 % éch. 20/10/2027	\$ 803	804	0,02								
Madison Park Euro Funding DAC											
3,927 % éch. 15/01/2032	€ 12 300	13 138	0,30								
Man GLG Euro CLO DAC											
4,216 % éch. 15/12/2031	11 089	11 879	0,27								
Massachusetts Educational Financing Authority											
6,205 % éch. 25/04/2038	\$ 5	5	0,00								
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust											
6,400 % éch. 25/10/2037	9 380	7 761	0,18								
MF1 LLC											
7,226 % éch. 19/06/2037	11 300	11 268	0,26								
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust											
5,330 % éch. 25/05/2037	544	474	0,01								
5,350 % éch. 25/09/2036	952	357	0,01								
5,380 % éch. 25/11/2036	941	519	0,01								

INSTRUMENTS A COURT TERME											
BILLETTS DE TRÉSORERIE											
AT+T, Inc.											
5,700 % éch. 19/03/2024		11 000	10 530								0,24
National Grid Holdings Ltd.											
5,450 % éch. 13/07/2023		5 150	5 140								0,12
VW Credit, Inc.											
5,400 % éch. 25/07/2023		9 150	9 116								0,21
Walgreens Boots Alliance											
6,000 % éch. 06/07/2023		1 800	1 798								0,04
Total des Instruments à court terme			26 584								0,61
Total des Valeurs mobilières			\$ 5 534 034								127,92

FONDS D'INVESTISSEMENT											
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF											
PIMCO Funds: Global Investors											
Series plc - Fonds US Short-Term Fund (f)		9 560 426	95 987								2,22
PIMCO Select Funds plc - Fonds											
PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)		16 473 452	164 042								3,79
Total des Fonds d'investissement			\$ 260 029								6,01

ACTIONS											
Action Logement Services											
0,500 % éch. 30/10/2034		7 600	6 038								0,14
Airport Authority Hong Kong											
4,750 % éch. 12/01/2028		1 300	1 297								0,03
4,875 % éch. 12/01/2030		5 000	5 085								0,12
Obligation internationale du gouvernement canadien											
2,250 % éch. 01/12/2029 CAI		38 600	27 268								0,63
Development Bank of Japan, Inc.											
0,010 % éch. 15/10/2024		6 600	6 840								0,16
0,875 % éch. 10/10/2025		4 300	4 386								0,10
Union européenne											
0,000 % éch. 04/10/2028 (c)		1 678	1 559								0,04
Obligation internationale du gouvernement hongrois											
1,750 % éch. 05/06/2035		10 000	7 665								0,18
Obligation internationale du gouvernement israélien											
3,800 % éch. 13/05/2060		1 000	762								0,02
4,125 % éch. 17/01/2048		1 000	858								0,02

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 1 321	Billets du Trésor américain 4,625 % éch. 30/06/2025	\$ (1 347)	\$ 1 321	\$ 1 321	0,03
Total des Contrats de mise en pension						\$ (1 347)	\$ 1 321	\$ 1 321	0,03

(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 septembre	Court	09/2023	1 506	\$ 2 774	0,06
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	582	(638)	(0,01)

Tableau des investissements Fonds Total Return 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 obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	1 393	\$ 1 823	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Court	09/2023	107	(223)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Court	09/2023	676	746	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	137	(446)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	976	(2 332)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	1 624	(3 028)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	667	(647)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	1 455	1 491	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	175	111	0,00
				\$ (369)	(0,01)

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	103	\$ (45)	\$ (39)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	103	(36)	(5)	0,00
Option de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	123,000	21/07/2023	30	(12)	(4)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	131,000	21/07/2023	30	(15)	(6)	0,00
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	98,000	15/12/2023	70	(57)	(3)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	70	(65)	(331)	(0,01)
				\$ (230)	\$ (388)	(0,01)

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ (757) (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 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 %	20/12/2023	\$ 7 300	\$ (72)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	12 400	56	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20/12/2023	€ 3 900	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2025	\$ 4 600	115	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2027	4 600	231	0,01
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	8 300	430	0,01
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	4 700	38	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2024	5 500	129	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2025	€ 14 500	2 511	0,06
Ryder System, Inc.	1,000	20/12/2023	\$ 1 500	29	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20/06/2028	6 700	23	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	500	8	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2028	6 200	11	0,00
				\$ 3 509	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 à 5 ans	(5,000) %	20/12/2025	\$ 9 408	\$ 252	0,01
Indice CDX.HY-36 à 5 ans	(5,000)	20/06/2026	5 292	255	0,01
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	(5,000)	20/06/2027	97 118	(6 436)	(0,16)
				\$ (5 929)	(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-39 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	\$ 4 100	\$ 34	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 recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,900 %	15/03/2052	£ 8 400	\$ 4 562	0,10
À recevoir ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250	20/09/2053	5 400	488	0,01
À recevoir ⁽⁴⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	24 300	1 764	0,04
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,062	18/09/2026	¥ 3 550 000	(217)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,063	19/09/2026	7 000	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	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,064 %	19/09/2026	¥ 877 000	\$ (55)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,380	18/06/2028	5 170 000	(117)	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2042	4 651 000	1 091	0,02
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,662	19/04/2042	260 000	86	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,705	31/10/2038	1 180 000	128	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,750	20/03/2038	436 000	(6)	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,750	20/12/2038	1 947 000	222	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,785	12/11/2038	600 000	54	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	22/10/2038	400 000	29	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	4 070 000	1 685	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,730	24/02/2032	\$ 14 800	(2 144)	(0,05)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	21/12/2052	65 900	5 006	0,11
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,765	16/03/2032	45 000	(6 309)	(0,15)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,943	21/04/2032	14 800	(1 817)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,150	15/06/2027	88 100	(5 975)	(0,14)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,680	11/07/2032	31 600	(2 138)	(0,05)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,690	11/07/2032	31 600	(2 104)	(0,05)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	6 800	(293)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,050	14/12/2052	9 570	408	0,01
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,156	10/03/2033	77 900	(50)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,300	06/03/2033	5 100	(121)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,340	23/02/2030	7 100	(176)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,370	01/03/2033	6 100	(103)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,400	23/02/2033	4 100	(61)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,405	01/03/2033	4 800	(68)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,425	01/03/2033	4 800	(62)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,430	27/02/2033	6 300	(78)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,450	07/03/2033	9 400	(102)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,470	22/02/2030	8 600	(144)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,525	02/03/2030	3 300	(46)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,750	21/06/2025	101 600	356	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,800	10/03/2028	8 900	(74)	0,00
À payer	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	4,000	21/06/2025	CAD 227 500	115	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,750	15/06/2027	NZD 39 100	(457)	(0,01)
À payer	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024	115 900	(863)	(0,02)
À payer	BBR NZD à 3 mois	4,250	21/12/2027	3 300	(44)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€ 4 000	(179)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	25 000	(2 655)	(0,06)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	21 000	(1 969)	(0,05)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,580	24/05/2024	239 500	(5 682)	(0,13)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	7 400	(164)	0,00
À payer ⁽⁴⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	132 600	1 152	0,03
					\$ (17 127)	(0,39)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (19 513)	(0,45)

⁽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.

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	3,750 %	12/09/2023	124 000	\$ 992	\$ 1 798	0,04
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	11/09/2023	116 900	877	1 692	0,04
							\$ 1 869	\$ 3 490	0,08

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

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 de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,250 %	12/09/2023	124 000	\$ (620)	\$ (1 229)	(0,03)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,750	12/09/2023	124 000	(372)	(702)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	01/12/2023	68 600	(213)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	68 600	(213)	(928)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,380	31/07/2023	4 700	(18)	(22)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	4 700	(18)	(14)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	3 200	(21)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	3 200	(21)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,060	14/07/2023	1 800	(13)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,360	14/07/2023	1 800	(13)	(4)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	2 200	(7)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	2 200	(7)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	1 800	(12)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	1 800	(12)	0	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	1 800	(6)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	1 800	(6)	(9)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	2 200	(5)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	2 200	(5)	(8)	0,00
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,233	11/09/2023	116 900	(550)	(1 175)	(0,03)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,715	11/09/2023	116 900	(328)	(693)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	1 900	(13)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	1 900	(13)	0	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	1 800	(6)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	1 800	(6)	(9)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	2 200	(5)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	2 200	(5)	(8)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	2 300	(8)	(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	10/07/2023	2 300	(8)	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,250	20/07/2023	5 000	(17)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	5 000	(17)	(21)	0,00
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,715	11/09/2023	116 700	(327)	(692)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	2 200	(7)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	06/07/2023	2 200	(7)	(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	10/07/2023	2 200	(8)	(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	10/07/2023	2 200	(8)	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	24/07/2023	2 200	(7)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,670	24/07/2023	2 200	(7)	(9)	0,00
							\$ (2 929)	\$ (5 582)	(0,13)

⁽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 colombien	1,000 %	20/06/2027	\$ 1 600	\$ (77)	\$ 28	\$ (49)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	400	(36)	18	(18)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	2 325	(108)	60	(48)	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	700	(25)	4	(21)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	3 000	(112)	20	(92)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	1 300	(116)	58	(58)	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	2 275	(104)	57	(47)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	400	(15)	3	(12)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	100	(5)	5	0	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	2 900	(104)	16	(88)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	3 400	(302)	153	(149)	(0,01)
					\$ (1 004)	\$ 422	\$ (582)	(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	07/2023	AUD 2 441	\$ 1 620	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
	07/2023	\$ 299	AUD 457	5	0	5	0,00
	08/2023	1 621	2 441	5	0	5	0,00
BOA	07/2023	CAD 45 106	\$ 33 150	0	(938)	(938)	(0,02)
	07/2023	€ 3 182	3 477	6	0	6	0,00
	07/2023	NZD 916	556	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	\$ 2 400	AUD 3 676	47	0	47	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
	07/2023	\$ 7 584	€ 7 049	\$ 107	\$ 0	\$ 107	0,00
	07/2023	668	PEN 2 448	7	0	7	0,00
	08/2023	¥ 627 100	\$ 4 391	24	0	24	0,00
	09/2023	HKD 18 102	\$ 2 317	3	0	3	0,00
	09/2023	TWD 110 762	\$ 3 649	85	0	85	0,00
	09/2023	\$ 9 930	IDR 148 646 905	0	(57)	(57)	0,00
	09/2023	8 593	INR 710 712	46	0	46	0,00
BPS	07/2023	AUD 1 745	\$ 1 156	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	CHF 96	106	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	CZK 2 815	131	2	0	2	0,00
	07/2023	€ 3 892	4 243	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	\$ 102	CHF 92	0	0	0	0,00
	07/2023	2 085	€ 1 917	7	0	7	0,00
	08/2023	CHF 91	\$ 102	0	0	0	0,00
	08/2023	TWD 55 440	1 816	35	0	35	0,00
	08/2023	\$ 1 157	AUD 1 745	6	0	6	0,00
	09/2023	THB 48	\$ 1	0	0	0	0,00
	09/2023	\$ 289	PEN 1 056	1	0	1	0,00
	12/2023	142	INR 11 717	0	0	0	0,00
BRC	08/2023	992	¥ 131 337	0	(78)	(78)	0,00
	09/2023	91	ILS 324	0	(3)	(3)	0,00
	09/2023	211	PEN 772	1	0	1	0,00
	12/2023	1 531	INR 126 372	0	(1)	(1)	0,00
BSH	07/2023	2 252	PEN 8 291	34	0	34	0,00
CBK	07/2023	CZK 2 484	\$ 115	1	0	1	0,00
	07/2023	£ 300	381	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 1 035	AUD 1 587	21	0	21	0,00
	07/2023	18 265	CLP 14 781 571	142	0	142	0,00
	07/2023	17 692	€ 16 407	218	(9)	209	0,01
	07/2023	1 293	£ 1 012	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	3 100	PEN 11 352	29	0	29	0,00
	08/2023	CNH 296	\$ 42	2	0	2	0,00
	08/2023	TWD 57 719	1 891	37	0	37	0,00
	08/2023	\$ 442	PEN 1 728	33	0	33	0,00
DUB	07/2023	8 852	£ 7 100	174	0	174	0,00
	09/2023	100	PEN 367	1	0	1	0,00
FAR	07/2023	29	CLP 22 678	0	0	0	0,00
GLM	07/2023	PEN 8 298	\$ 2 267	0	(21)	(21)	0,00
	07/2023	\$ 896	PEN 3 271	5	0	5	0,00
	09/2023	4 073	14 937	23	0	23	0,00
	09/2023	12 262	TWD 373 183	0	(255)	(255)	(0,01)
JPM	07/2023	€ 13 846	\$ 14 893	0	(302)	(302)	(0,01)
	07/2023	\$ 2 308	AUD 3 531	42	0	42	0,00
	07/2023	761 149	€ 697 087	0	(627)	(627)	(0,01)
	08/2023	€ 697 087	\$ 762 214	651	0	651	0,02
	08/2023	\$ 162	¥ 21 584	0	(12)	(12)	0,00
	09/2023	IDR 240 583	\$ 16	0	0	0	0,00
	09/2023	INR 4 664	57	0	0	0	0,00
	09/2023	PEN 77 395	21 020	0	(204)	(204)	0,00
	09/2023	\$ 4 133	IDR 62 180 258	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	88	ILS 311	0	(4)	(4)	0,00
	09/2023	14	PEN 50	0	0	0	0,00
	09/2023	8 110	THB 278 124	0	(207)	(207)	0,00
	12/2023	9 131	INR 753 530	0	(3)	(3)	0,00
MBC	07/2023	€ 5 136	\$ 5 493	0	(110)	(110)	0,00
	07/2023	£ 255 628	316 433	0	(8 562)	(8 562)	(0,20)
MYI	07/2023	\$ 9 850	€ 9 131	112	0	112	0,00
	07/2023	£ 35	\$ 44	0	0	0	0,00
	07/2023	IDR 39 185 115	2 620	7	0	7	0,00
	07/2023	\$ 5	CHF 4	0	0	0	0,00
	07/2023	607	€ 557	0	0	0	0,00
	07/2023	1 574	£ 1 264	33	0	33	0,00
	07/2023	2 608	IDR 39 185 115	6	0	6	0,00
	08/2023	TWD 59 657	\$ 1 987	51	0	51	0,00
	08/2023	\$ 14 152	¥ 1 880 695	0	(1 057)	(1 057)	(0,02)
	08/2023	31	TWD 960	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	INR 1 007	\$ 12	0	0	0	0,00
	09/2023	\$ 2 620	IDR 39 219 177	0	(15)	(15)	0,00
	09/2023	3 703	THB 126 775	0	(100)	(100)	0,00
RBC	08/2023	MXN 2 245	\$ 130	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	AUD 3 585	2 380	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	NZD 2 385	1 448	0	(13)	(13)	0,00
	07/2023	\$ 3 257	AUD 4 984	61	0	61	0,00
	07/2023	1 048	£ 834	12	0	12	0,00
	08/2023	CNH 204	\$ 30	2	0	2	0,00
	08/2023	\$ 2 382	AUD 3 585	6	0	6	0,00
	09/2023	IDR 238 245 988	\$ 16 023	197	0	197	0,00
	09/2023	INR 2 917	35	0	0	0	0,00
	09/2023	TWD 92 552	3 036	58	0	58	0,00
	09/2023	\$ 1 553	PEN 5 720	16	0	16	0,00
	09/2023	8 335	THB 287 811	0	(156)	(156)	0,00
SOG	07/2023	€ 705 535	\$ 758 972	0	(10 768)	(10 768)	(0,25)
	07/2023	\$ 1 974	AUD 3 017	34	0	34	0,00

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	
SSB	08/2023	CLP	14 774 113	\$ 18 222	\$ 0	\$ (131)	0,00	
TOR	07/2023	AUD	4 412	2 914	0	(23)	0,00	
	07/2023	\$	1 044	AUD 1 597	19	0	0,00	
	07/2023		34 091	CAD 45 109	24	(25)	0,00	
	07/2023		312 404	£ 245 852	160	0	0,00	
	07/2023		2 010	NZD 3 301	12	0	0,00	
	08/2023	CAD	45 091	\$ 34 091	24	(23)	0,00	
	08/2023	£	245 852	312 472	0	(154)	0,00	
	08/2023	NZD	3 301	2 010	0	(12)	0,00	
	08/2023	\$	2 916	AUD 4 412	23	0	0,00	
	08/2023		6 532	¥ 866 175	0	(501)	(0,01)	
UAG	07/2023	AUD	7 031	\$ 4 695	25	(10)	0,00	
	07/2023	\$	239	AUD 365	4	0	0,00	
	08/2023		4 699	7 031	9	(24)	0,00	
	09/2023	SGD	22 211	\$ 16 619	160	0	0,00	
	09/2023	\$	75	ILS 269	0	(2)	0,00	
	09/2023		8 133	INR 672 355	40	0	0,00	
					\$ 2 895	\$ (24 443)	\$ (21 548)	(0,50)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	
BOA	07/2023	CAD	363	\$ 271	\$ 0	\$ (3)	0,00	
	07/2023	\$	2 566	CAD 3 479	72	0	0,01	
CBK	07/2023		161		5	7	0,00	
JPM	07/2023		2 542	3 449	64	64	0,00	
MBC	07/2023	CAD	689	\$ 518	0	(3)	0,00	
	07/2023	\$	58	CAD 78	1	0	0,00	
MYI	07/2023	CAD	60	\$ 45	0	0	0,00	
SCX	07/2023	\$	2 557	CAD 3 473	67	0	0,00	
TOR	07/2023	CAD	5 678	\$ 4 285	2	(7)	0,00	
	08/2023	\$	4 285	CAD 5 675	8	(2)	0,00	
					\$ 219	\$ (15)	\$ 204	0,01

Au 30 juin 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	07/2023	CHF	5 627	\$ 6 291	\$ 2	\$ 0	0,00	
	07/2023	\$	8 407	CHF 7 605	93	0	0,00	
	08/2023		6 291	5 611	0	(2)	0,00	
CLY	07/2023	CHF	2 974	\$ 3 311	0	(13)	0,00	
	08/2023	\$	3 311	CHF 2 965	13	0	0,00	
JPM	07/2023		107		1	1	0,00	
MBC	07/2023	CHF	72	\$ 81	0	0	0,00	
	07/2023	\$	373	CHF 336	2	0	0,00	
MYI	07/2023	CHF	188	\$ 208	0	(2)	0,00	
	07/2023	\$	109	CHF 99	1	0	0,00	
RYL	07/2023	CHF	9	\$ 10	0	0	0,00	
SCX	07/2023	\$	5 878	CHF 5 282	26	0	0,00	
UAG	07/2023	CHF	5 827	\$ 6 501	0	(13)	0,00	
	07/2023	\$	5 297	CHF 4 759	23	0	0,00	
	08/2023		6 501	5 811	13	0	0,00	
					\$ 174	\$ (30)	\$ 144	0,00

Au 30 juin 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	
BOA	07/2023	€	1 393	\$ 1 520	\$ 2	\$ (3)	0,00	
	07/2023	\$	404 146	€ 376 053	6 127	0	0,14	
BPS	07/2023	€	381 416	\$ 417 909	1 786	(2)	0,04	
	07/2023	\$	404 314	€ 376 103	6 014	0	0,14	
	08/2023		416 017	379 148	0	(1 798)	(0,04)	
CBK	07/2023	€	409 338	\$ 444 652	2	(1 937)	(0,04)	
	07/2023	\$	10 133	€ 9 339	56	0	0,00	
	08/2023		413 798	380 073	1 429	0	0,03	
JPM	07/2023	€	380 073	\$ 415 001	342	0	0,01	
	07/2023	\$	31 065	€ 29 056	634	0	0,01	
	08/2023		415 582	380 073	0	(354)	(0,01)	
MBC	07/2023	€	7 352	\$ 7 895	0	(126)	0,00	
	07/2023	\$	14 430	€ 13 489	287	(1)	0,01	
SOG	07/2023		404 589	376 103	5 740	0	0,13	
					\$ 22 419	\$ (4 221)	\$ 18 198	0,42

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 50	£ 40	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	07/2023	10 762	8 698	298	(1)	297	0,01
BRC	07/2023	£ 181	\$ 226	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	\$ 173	£ 137	1	0	1	0,00
CBK	07/2023	£ 21	\$ 26	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 646	£ 511	4	(1)	3	0,00
JPM	07/2023	£ 8 727	\$ 11 034	0	(61)	(61)	(0,01)
	08/2023	\$ 11 037	£ 8 727	61	0	61	0,00
MBC	07/2023	£ 10	\$ 43	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 10 716	£ 8 656	289	0	289	0,01
MYI	07/2023	10 591	8 521	243	0	243	0,01
TOR	07/2023	£ 8 730	\$ 11 094	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	\$ 11 096	£ 8 730	5	0	5	0,00
				\$ 901	\$ (74)	\$ 827	0,02

Au 30 juin 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
BRC	07/2023	\$ 9 164	SGD 12 400	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
GLM	07/2023	SGD 1 009	\$ 751	5	0	5	0,00
	07/2023	\$ 386	SGD 520	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07/2023	SGD 12 126	\$ 8 961	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 1 543	SGD 2 088	0	0	0	0,00
	08/2023	8 961	12 114	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07/2023	SGD 26	\$ 20	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 8 327	SGD 11 250	0	(14)	(14)	0,00
MYI	07/2023	SGD 11 725	\$ 8 678	14	0	14	0,00
	08/2023	\$ 8 678	SGD 11 715	0	(13)	(13)	0,00
UAG	07/2023	SGD 228	\$ 169	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 9 030	SGD 12 215	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 21	\$ (36)	\$ (15)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ (4 864) (0,11)

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION

AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN

Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA

2,000 % éch. 01/08/2053

\$ 32 300 \$ (26 386) (0,61)

2,500 % éch. 01/08/2053

49 700 (42 214) (0,98)

Total des Titres vendus à découvert

\$ (68 600) (1,59)

Total des Investissements

\$ 5 701 650 131,79

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (1 375 281) (31,79)

Actifs nets

\$ 4 326 369 100,00

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 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) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 9 570 \$ (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 30 juin 2023.

(i) Un titre d'une juste valeur globale de 7 928 \$ (31 décembre 2022 : 25 953 \$) 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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 320 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 76 292 \$ (31 décembre 2022 : 94 783 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

Un montant en numéraire de 12 000 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 5 532 045	\$ 1 989	\$ 5 534 034
Fonds d'investissement	260 029	0	0	260 029
Contrats de mise en pension	0	1 321	0	1 321
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	4 036	(29 170)	0	(25 134)
Titres vendus à découvert	0	(68 600)	0	(68 600)
Totaux	\$ 264 065	\$ 5 435 596	\$ 1 989	\$ 5 701 650

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 30 juin 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	0,000 %	21/06/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (2 919)	\$ (3 185)	(0,07)
	1,000	13/06/2023	TBD ⁽¹⁾	(3 006)	(3 284)	(0,08)
	2,000	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(449)	(491)	(0,01)
	2,850	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(1 232)	(1 349)	(0,03)
MYI	1,500	10/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(1 004)	(1 098)	(0,03)
Total des Contrats de prise en pension					\$ (9 407)	(0,22)

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

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 30 juin 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	5,080 %	28/06/2023	05/07/2023	\$ (7 978)	\$ (7 982)	(0,18)
Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos					\$ (7 982)	(0,18)

⁽¹⁾ Le montant à payer sur les opérations 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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 5	\$ (10)	\$ (5)	\$ (27)	\$ 0	\$ (27)
BOA	4 394	(2 980)	1 414	(167)	280	113
BPS	6 362	(5 480)	882	1 927	(1 740)	187
BRC	(160)	0	(160)	(182)	20	(162)
BSH	34	0	34	S/O	S/O	S/O
CBK	5	0	5	8 777	(8 710)	67
CLY	S/O	S/O	S/O	4	0	4
DUB	175	0	175	374	(270)	104
FAR	(176)	0	(176)	1	0	1
GLM	(270)	0	(270)	(710)	600	(110)
GST	(150)	260	110	(273)	260	(13)
JPM	(69)	0	(69)	(176)	0	(176)
MBC	(8 125)	5 980	(2 145)	6 728	(6 220)	508

Contrepartie	Au 30 juin 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⁾
MYC	\$ (946)	\$ 790	\$ (156)	\$ (550)	\$ 470	\$ (80)
MYI	(833)	960	127	(406)	270	(136)
RBC	S/O	S/O	S/O	(4)	0	(4)
RYL	S/O	S/O	S/O	1	0	1
SAL	S/O	S/O	S/O	(68)	0	(68)
SCX	269	(290)	(21)	(11 948)	11 385	(563)
SOG	(4 994)	3 690	(1 304)	(34)	0	(34)
SSB	(131)	50	(81)	S/O	S/O	S/O
TOR	(476)	270	(206)	(2)	600	598
UAG	222	(210)	12	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	59,27	66,92
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	68,65	47,33
Autres valeurs mobilières	S/O	0,68
Fonds d'investissement	6,01	7,05
Contrats de mise en pension	0,03	4,12
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,02)	0,86
Instruments financiers dérivés compensés	(0,45)	(0,84)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,11)	0,08
Titres vendus à découvert	(1,59)	(1,65)
Contrats de prise en pension	(0,22)	(0,04)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	(0,18)	(1,85)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	37,20	36,37
Obligations et billets municipaux	0,53	0,28
Agences du gouvernement américain	50,62	37,34
Obligations du Trésor américain	18,92	17,09
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	9,03	9,41
Titres adossés à des actifs	8,52	9,66
Émissions souveraines	2,49	2,46
Instruments à court terme	0,61	2,32
Fonds d'investissement	6,01	7,05
Contrats de mise en pension	0,03	4,12
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,01)	0,87
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	(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	(0,14)	(0,12)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	S/O
Swaps de taux d'intérêt	(0,39)	(0,79)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,08	0,07
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,13)	(0,11)
Options sur titres	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,01)	(0,03)
Contrats de change à terme	(0,50)	(0,57)
Contrats de change à terme couverts	0,45	0,72
Titres vendus à découvert	(1,59)	(1,65)
Autres actifs et passifs à court terme	(31,79)	(24,55)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy 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 BILLETTS PRIVÉS				BANQUE ET FINANCE				
AerCap Ireland Capital DAC	3,150	\$ 1,521	0,50	Lloyds Banking Group PLC	1 000	998	0,33	Eni SpA	4 000	3 983	1,32	
American Express Co.	5,801	1 402	0,46	Mitsubishi HC Capital, Inc.	3,960	2 786	0,92	HCA, Inc.	3 100	3 081	1,02	
American Tower Corp.	5,000	497	0,16	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	2 000	1 978	0,65	Hyundai Capital America	2 000	1 948	0,64	
Aozora Bank Ltd.	1 800	1 689	0,56	Mizuho Financial Group, Inc.	2 700	2 673	0,88	Nissan Motor Co. Ltd.	2 200	2 185	0,72	
Athene Global Funding	2 500	2 426	0,80	Morgan Stanley	2 500	2 498	0,83	NXP BV	3 800	3 774	1,25	
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	3 600	3 563	1,18	MUFG Bank Ltd.	1 500	999	0,33	Penske Truck Leasing Co. LP	3 000	2 961	0,98	
Banco Santander S.A.	3 892	1 177	0,39	National Australia Bank Ltd.	4 000	2 666	0,88	Siemens Financieringsmaatschappij NV	1 527	1 529	0,51	
Bank of America Corp.	500	492	0,16	National Bank of Canada	3 500	3 493	1,16	SK Broadband Co. Ltd.	1 000	998	0,33	
Bank of Montreal	3 435	3 424	1,13	Nationwide Building Society	600	582	0,19	Starbucks Corp.	1 707	1 707	0,56	
Bank of Nova Scotia	800	800	0,26	Nissan Motor Acceptance Co. LLC	400	384	0,13	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.	333	331	0,11	
BNP Paribas S.A.	2 833	2 797	0,93	Nomura Holdings, Inc.	3 800	3 599	1,189	Thermo Fisher Scientific, Inc.	3 800	3 800	1,26	
BPCE S.A.	1 500	1 493	0,49	Nordea Bank Abp	1 000	1 001	0,33	Tyson Foods, Inc.	1 000	996	0,33	
Capital One Financial Corp.	2 400	2 373	0,79	Pacific Life Global Funding	1 200	1 182	0,39	Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	1 000	987	0,33	
CK Hutchison International Ltd.	1 000	982	0,32	Santander UK Group Holdings PLC	1 500	1 489	0,49	4,400 % éch. 15/03/2024	1 000	51 143	16,91	
CNH Industrial Capital LLC	1 800	1 800	0,60	Société Générale S.A.	2 661	2 649	0,88	SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Cooperative Rabobank UA	500	332	0,11	Standard Chartered PLC	200	198	0,07	British Telecommunications PLC	2 700	2 685	0,89	
Danske Bank A/S	1 700	1 690	0,56	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	2 564	2 567	0,85	Chugoku Electric Power Co., Inc.	1 000	958	0,32	
Deutsche Bank AG	2 138	2 141	0,71	Toronto-Dominion Bank	200	200	0,07	Enel Finance International NV	1 000	963	0,32	
First Abu Dhabi Bank PJSC	500	332	0,11	Toyota Motor Credit Corp.	4 200	4 200	1,39	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	300	294	0,10	
GA Global Funding Trust	1 000	1 001	0,33	UBS AG	1 200	1 196	0,40	2,940 % éch. 21/03/2024	2 000	2 000	0,66	
General Motors Financial Co., Inc.	700	686	0,23	5,540 % éch. 09/08/2024	100 835	33,35	5,481 % éch. 03/11/2023	500	500	0,17		
Goldman Sachs Group, Inc.	1 300	867	0,29	INDUSTRIE				6,112 % éch. 21/03/2024	600	590	0,19	
HSBC Holdings PLC	800	803	0,27	AstraZeneca PLC	400	400	0,13	Pacific Gas & Electric Co.	800	799	0,26	
Hyundai Capital Services, Inc.	1 200	1 187	0,39	Ausgrid Finance Pty. Ltd.	1 000	652	0,22	1,700 % éch. 15/11/2023	600	590	0,19	
ING Bank Australia Ltd.	1 600	1 042	0,34	Baxter International, Inc.	3 500	3 493	1,15	4,250 % éch. 01/08/2023	800	799	0,26	
ING Groep NV	1 760	1 762	0,58	Bayer U.S. Finance LLC	1 000	991	0,33	Transpower New Zealand Ltd.	6 000	4 001	1,32	
Jackson Financial, Inc.	1 000	982	0,32	Boeing Co.	1 900	1 850	0,61	Verizon Communications, Inc.	1 500	1 513	0,50	
Jackson National Life Global Funding	400	401	0,13	Broadcom Corp.	499	493	0,16	Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd.	500	331	0,11	
JPMorgan Chase & Co.				Charter Communications Operating LLC	1 000	991	0,33	Vodafone Group PLC	500	501	0,17	
				Cigna Group	1 400	1 400	0,46	6,250 % éch. 16/01/2024	15 135	5,01		
				CNH Industrial NV	1 606	1 604	0,53	AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
				Daimler Truck Finance North America LLC	1 500	1 469	0,49	Federal Home Loan Bank	4 000	3 993	1,32	
				Energy Transfer LP	1 565	1 566	0,52	Ginnie Mae	500	509	0,17	
								5,099 % éch. 20/09/2066	488	485	0,16	
								5,924 % éch. 20/08/2066	2 150	2 140	0,71	
								TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
								DBWF Mortgage Trust	500	493	0,16	
								Dilosk RMBS DAC	303	331	0,11	
								Sage AR Funding PLC	200	248	0,08	
								5,969 % éch. 17/11/2030				

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,635 % éch. 20/10/2051	£ 174	\$ 221	0,07	EMISSIONS SOUVERAINES				BILLETTS À COURT TERME			
Towd Point Mortgage Trust 4,604 % éch. 25/02/2057	\$ 79	79	0,03	CPIB Capital, Inc. 6,342 % éch. 04/04/2025	\$ 3 000	\$ 3 048	1,01	DBS Bank Ltd. 4,467 % éch. 22/11/2023 (e)	AUD 7 000	\$ 4 660	1,54
Trinity Square PLC 5,316 % éch. 15/07/2059	£ 127	162	0,06	Export-Import Bank of Korea 4,628 % éch. 30/10/2023	AUD 5 700	3 798	1,25	BONS DU TRÉSOR JAPONAIS			
Tudor Rose Mortgages 5,509 % éch. 20/06/2048	261	331	0,11	Obligation internationale du gouvernement israélien 3,750 % éch. 31/03/2024	ILS 100	27	0,01	(0,206) % éch.			
		1 865	0,62	Korea Expressway Corp. 0,928 % éch. 02/09/2023	AUD 2 500	1 653	0,55	18/07/2023 (a)(b)	¥ 81 000	560	0,19
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				Korea National Oil Corp. 6,135 % éch. 16/07/2023	\$ 800	800	0,26	(0,188) % éch.	439 000	3 038	1,00
Carlyle Euro CLO DAC 4,213 % éch. 15/08/2032	€ 300	320	0,11			9 326	3,08	(0,186) % éch.	985 000	6 816	2,25
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,400 % éch. 15/07/2031	\$ 5 996	5 939	1,96	INSTRUMENTS À COURT TERME				07/08/2023 (a)(b)	375 000	2 595	0,86
CBAM Ltd. 6,370 % éch. 20/10/2029	490	487	0,16	BILLETTS DE TRÉSORERIE						13 009	4,30
EFS Volunteer LLC 6,105 % éch. 25/10/2035	69	69	0,02	Dominion Resources, Inc. 5,430 % éch. 31/07/2023	1 200	1 194	0,40	Total des Instruments à court terme		39 097	12,93
Elevation CLO Ltd. 6,478 % éch. 15/10/2029	587	587	0,19	5,450 % éch. 26/07/2023	1 500	1 494	0,49	Total des Valeurs mobilières		\$ 237 254	78,47
Euro-Galaxy CLO DAC 3,831 % éch. 24/04/2034	€ 250	265	0,09	Enbridge, Inc. 5,470 % éch. 14/07/2023	2 800	2 794	0,93	ACTIONS			
Greenwood Park CLO Ltd. 6,270 % éch. 15/04/2031	\$ 1 600	1 577	0,52	Global Payments, Inc. 5,930 % éch. 26/07/2023	300	299	0,10	FONDS D'INVESTISSEMENT			
Harvest CLO DAC 4,250 % éch. 26/06/2030	€ 222	237	0,08	5,950 % éch. 14/07/2023	2 400	2 394	0,79	ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
Madison Park Funding Ltd. 6,010 % éch. 15/04/2029	\$ 190	188	0,06	Humana, Inc. 5,500 % éch. 01/08/2023	2 700	2 687	0,89	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	1 919 787	19 117	6,32
Magnetite Ltd. 6,382 % éch. 18/10/2031	2 400	2 385	0,79	Keurig Dr Pepper, Inc. 5,250 % éch. 05/07/2023	300	300	0,10	FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
Oak Hill European Credit Partners DAC 3,940 % éch. 20/10/2031	€ 300	319	0,11	Targa Resources Corp. 5,950 % éch. 20/07/2023	1 100	1 097	0,36	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)	109 710	10 898	3,61
SLM Private Credit Student Loan Trust 5,842 % éch. 15/06/2039	\$ 372	353	0,12	Thomson Reuters Corp. 5,470 % éch. 18/07/2023	2 800	2 793	0,92	Total des Fonds d'investissement		\$ 30 015	9,93
		12 726	4,21	5,500 % éch. 18/07/2023	800	798	0,26				
				Trane Technologies Fing Ltd. 5,550 % éch. 24/07/2023	3 000	2 989	0,99				
				VW Credit, Inc. 5,430 % éch. 27/07/2023	2 600	2 589	0,86				
						21 428	7,09				

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
BPS	5,160 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 2 500	Billets du Trésor américain 2,000 % éch. 15/08/2025	\$ (2 553)	\$ 2 500	\$ 2 501	0,83
SSB	2,400	30/06/2023	03/07/2023	2 083	Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 30/06/2026	(2 125)	2 083	2 083	0,69
Total des Contrats de mise en pension						\$ (4 678)	\$ 4 583	\$ 4 584	1,52

(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 juin	Court	06/2024	162	\$ 110	0,04
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	313	553	0,18
Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois juin	Court	09/2024	120	474	0,16
Contrats à terme standardisés sur Indice SONIA Index à 3 mois mars	Court	06/2024	20	108	0,04
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans septembre	Court	09/2023	486	188	0,06
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans septembre	Court	09/2023	82	34	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice BIST 30 Index août	Long	08/2023	425	56	0,02
Contrats à terme standardisés sur Indice CAC 40 Index juillet	Long	07/2023	18	22	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice DAX Index septembre	Long	09/2023	4	5	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini NASDAQ 100 Index septembre	Long	09/2023	22	224	0,07
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini Russell 2000 Index septembre	Long	09/2023	12	5	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index septembre	Long	09/2023	9	31	0,01
Contrats à terme standardisés sur Euro STOXX Bank septembre	Long	09/2023	810	165	0,05
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Long	09/2023	37	26	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien septembre	Court	09/2023	253	106	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans septembre	Court	09/2023	14	11	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index septembre	Long	09/2023	12	(12)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE China A50 Index juillet	Court	07/2023	796	(53)	(0,02)

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy 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 Indice FTSE Taiwan Index juillet	Long	07/2023	213	(89)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/JSE Index septembre	Long	09/2023	103	(33)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/MIB Index septembre	Long	09/2023	15	72	0,02
Contrats à terme standardisés sur Indice IBEX 35 Index juillet	Long	07/2023	23	70	0,02
Contrats à terme standardisés sur Indice MSCI Singapore Index juillet	Court	07/2023	122	15	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice Nikkei 225 Index septembre	Long	09/2023	38	150	0,05
Contrats à terme standardisés sur Indice OMXS30 Index juillet	Long	07/2023	264	(36)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Indice S&P CNX Nifty Index juillet	Long	07/2023	383	354	0,12
Contrats à terme standardisés sur S&P/Toronto Stock Exchange 60 septembre	Long	09/2023	1	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice SPI 200 Index septembre	Long	09/2023	38	35	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice Topix Index septembre	Long	09/2023	69	356	0,12
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Long	09/2023	55	(45)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	125	128	0,04
Contrats à terme standardisés sur Indice Volatility S&P 500 Index juillet	Court	07/2023	269	425	0,14
Contrats à terme standardisés sur VSTOXX Mini juillet	Court	07/2023	835	136	0,04
Contrats à terme standardisés sur Indice WIG20 Index septembre	Long	09/2023	689	21	0,01
				\$ 3 615	1,19

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 3 615 1,19

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 à 5 ans	1,000 %	20/06/2028	\$ 45 800	\$ 223	0,07
Indice CDX.HY-40 à 5 ans	5,000	20/06/2028	6 200	83	0,03
Indice iTraxx Crossover 39 à 5 ans	5,000	20/06/2028	€ 5 700	20	0,01
				\$ 326	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 ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250 %	20/09/2053	£ 6 100	\$ 100	0,03
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	36 300	556	0,18
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	24 900	311	0,10
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	15/03/2028	INR 2 855 400	(222)	(0,07)
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	15/03/2028	1 213 800	105	0,03
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	¥ 80 000	(19)	(0,01)
À payer ⁽³⁾	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,850	20/09/2033	6 760 000	(118)	(0,04)
À payer ⁽³⁾	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	1,200	20/09/2053	1 660 000	(44)	(0,01)
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750	15/03/2028	SGD 35 700	264	0,09
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,000	15/03/2028	16 800	97	0,03
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	20/09/2028	\$ 4 900	55	0,02
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	20/09/2033	4 000	11	0,00
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	3,000	20/09/2053	2 400	(23)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,338	02/01/2025	BRL 14 100	(182)	(0,06)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,580	02/01/2025	10 300	(205)	(0,07)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,770	02/01/2025	3 300	(71)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,840	02/01/2025	11 400	(244)	(0,08)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,877	02/01/2025	3 000	(61)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,620	02/01/2025	5 500	108	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,630	02/01/2025	4 900	96	0,03
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,840	02/01/2025	16 800	384	0,13
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,010	02/01/2025	7 900	173	0,06
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,328	02/01/2025	20 000	398	0,13
À payer	CDI BRL à 1 an	7,715	02/01/2025	7 800	(150)	(0,05)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,733	02/01/2025	8 200	148	0,05
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,180	02/01/2025	14 600	246	0,08
À payer	CDI BRL à 1 an	8,550	02/01/2025	700	(11)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,730	02/01/2025	21 700	305	0,10
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,985	02/01/2025	10 900	138	0,05
À recevoir	CDI BRL à 1 an	9,525	02/01/2025	13 300	132	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	9,630	02/01/2025	4 500	40	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	10,295	04/01/2027	6 000	(34)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,445	04/01/2027	20 100	(56)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	10,480	02/01/2029	28 400	(34)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,813	02/01/2025	10 500	(40)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,043	04/01/2027	10 400	(12)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,070	04/01/2027	8 900	10	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	11,080 %	02/01/2029	BRL 15 500	\$ 47	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,106	02/01/2029	26 900	130	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	11,180	04/01/2027	17 900	32	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,240	04/01/2027	24 300	86	0,03
À payer	CDI BRL à 1 an	11,310	02/01/2029	22 800	137	0,05
À payer	CDI BRL à 1 an	11,350	04/01/2027	63 000	237	0,08
À payer	CDI BRL à 1 an	11,360	02/01/2029	24 000	151	0,05
À payer	CDI BRL à 1 an	11,426	04/01/2027	7 500	30	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,451	04/01/2027	37 800	(177)	(0,06)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,505	04/01/2027	25 100	283	0,09
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,595	04/01/2027	28 200	(155)	(0,05)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,620	04/01/2027	36 700	(256)	(0,08)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,660	02/01/2029	500	(4)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,665	04/01/2027	9 100	(44)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,837	02/01/2029	63 300	570	0,19
À payer	CDI BRL à 1 an	11,890	02/01/2025	66 400	152	0,05
À payer	CDI BRL à 1 an	11,918	04/01/2027	28 000	189	0,06
À payer	CDI BRL à 1 an	11,940	02/01/2029	17 600	169	0,06
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,945	04/01/2027	21 800	(146)	(0,05)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,058	02/01/2029	89 700	924	0,31
À payer	CDI BRL à 1 an	12,080	04/01/2027	12 200	94	0,03
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,140	04/01/2027	6 000	(47)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,190	02/01/2029	19 900	(20)	0,07
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,195	04/01/2027	25 200	230	(0,08)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,260	04/01/2027	27 200	257	0,09
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,455	04/01/2027	7 900	(76)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,455	02/01/2029	16 600	202	0,07
À payer	CDI BRL à 1 an	12,560	02/01/2029	36 400	480	0,16
À payer	CDI BRL à 1 an	12,640	02/01/2029	34 000	463	0,15
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,718	04/01/2027	35 400	(395)	(0,13)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,740	04/01/2027	45 700	(534)	(0,18)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,770	04/01/2027	11 000	126	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,030	04/01/2027	35 600	(475)	(0,16)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,080	04/01/2027	47 200	(634)	(0,21)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,165	04/01/2027	27 200	(325)	(0,11)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,190	04/01/2027	34 700	(485)	(0,16)
À payer	CDI BRL à 1 an	13,280	04/01/2027	9 600	137	0,05
À recevoir ⁽³⁾	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,000	20/09/2028	CAD 18 500	92	0,03
À recevoir ⁽³⁾	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,000	20/09/2033	30 100	(73)	(0,02)
À payer ⁽³⁾	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,250	20/09/2053	8 500	105	0,03
À recevoir ⁽³⁾	CAONREPO CAD composé-OIS à 3 mois	3,750	20/09/2025	67 800	320	0,11
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,250	21/12/2027	CNY 61 900	73	0,02
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,645	16/12/2025	8 600	8	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	15/03/2028	123 500	(186)	(0,06)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	3,000	15/03/2028	373 000	553	0,18
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,034	13/01/2026	COP 2 305 800	(79)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,220	11/12/2025	1 542 400	20	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,295	09/10/2025	1 638 900	(29)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,400	28/08/2025	1 571 400	24	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,850	24/04/2025	2 558 800	(51)	(0,02)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,940	05/03/2026	4 713 300	126	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,110	23/03/2026	6 908 300	173	0,06
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,240	16/04/2026	4 566 900	129	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,350	27/03/2025	625 600	12	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,360	30/03/2025	836 600	16	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,490	30/04/2026	3 271 600	(86)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,660	11/06/2026	1 410 500	32	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,880	07/05/2026	3 283 600	(76)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,150	13/03/2025	121 800	3	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,980	14/10/2026	4 816 400	(87)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,190	05/11/2026	9 002 000	137	0,05
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,360	19/11/2026	5 335 800	(71)	(0,02)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,410	08/11/2026	5 252 200	91	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,950	04/02/2027	6 498 500	61	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,730	28/06/2028	15 146 400	12	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,900	08/04/2027	4 251 300	(10)	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,106	15/06/2028	22 329 600	102	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,494	27/05/2027	5 817 600	(24)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,588	11/04/2028	27 727 300	192	0,06
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,700	10/04/2028	5 318 200	42	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,750	27/03/2028	21 497 700	220	0,07
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,830	28/04/2028	19 856 000	(231)	(0,08)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,850	06/05/2027	6 000 000	(38)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,970	05/08/2027	8 528 200	71	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,970	08/02/2028	9 288 600	98	0,03
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,990	08/02/2028	22 636 600	243	0,08
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,992	08/02/2028	23 240 200	250	0,08
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,020	24/03/2028	33 052 700	418	0,14
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	503	0,17
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,160	20/05/2027	8 106 600	(75)	(0,02)

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	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,050 %	09/09/2027	COP 8 150 200	\$ (154)	(0,05)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,210	18/11/2027	3 214 900	67	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,240	24/02/2028	72 000 000	(1 647)	(0,54)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,275	18/11/2027	6 380 400	137	0,05
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,390	30/09/2027	10 319 800	(228)	(0,08)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,420	21/11/2027	6 380 400	146	0,05
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,430	21/11/2027	6 563 400	150	0,05
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,443	21/11/2027	19 784 200	456	0,15
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,478	29/09/2027	10 549 600	(241)	(0,08)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,800	31/10/2027	32 387 900	(1 063)	(0,35)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,810	14/10/2027	5 776 200	(145)	(0,05)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,920	18/10/2027	2 950 700	(77)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,940	18/10/2027	5 920 600	(156)	(0,05)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,424	21/10/2027	13 833 600	425	0,14
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,450	21/10/2027	4 011 800	124	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,800	24/10/2027	33 238 700	(1 066)	(0,35)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,850	24/10/2027	1 323 300	46	0,02
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,500	17/03/2026	HKD 26 700	(61)	(0,02)
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,508	17/03/2026	4 700	(11)	0,00
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,550	16/12/2025	4 700	10	0,00
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,560	17/03/2026	3 200	(7)	0,00
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,565	16/12/2025	7 800	(17)	(0,01)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,568	17/03/2026	6 300	14	0,00
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,583	16/12/2025	7 900	(17)	(0,01)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,607	17/03/2026	9 400	22	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,608	17/03/2026	7 900	18	0,01
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,618	16/09/2025	7 800	(16)	(0,01)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,670	17/03/2026	12 600	29	0,01
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,680	16/12/2025	3 200	(7)	0,00
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,698	16/12/2025	3 100	7	0,00
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,700	16/09/2025	11 100	22	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,750	15/09/2026	39 600	88	0,03
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,790	16/09/2025	4 700	(10)	0,00
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,867	17/03/2026	31 700	74	0,02
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,883	15/09/2026	7 800	(20)	(0,01)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,000	17/03/2026	11 100	26	0,01
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	1,000	16/06/2026	43 400	(109)	(0,04)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,085	16/09/2025	11 200	23	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,100	16/06/2026	12 700	32	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,120	17/06/2025	3 200	6	0,00
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,250	15/12/2026	48 800	149	0,05
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	1,340	18/03/2025	8 000	(12)	0,00
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	1,500	16/03/2027	48 910	(157)	(0,05)
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	1,600	17/06/2025	5 900	(11)	0,00
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	1,715	18/03/2025	10 800	(17)	(0,01)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,750	16/03/2027	9 800	29	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	2,000	16/03/2027	11 500	35	0,01
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	2,750	16/03/2027	18 400	(59)	(0,02)
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	3,000	15/06/2027	5 000	(16)	(0,01)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	3,000	21/09/2027	10 400	29	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	3,250	21/09/2027	46 600	166	0,05
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	3,250	15/03/2028	287 300	(1 198)	(0,40)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	3,500	21/09/2027	27 940	96	0,03
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	3,750	21/09/2027	40 600	149	0,05
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	3,750	15/03/2028	229 200	126	0,04
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	4,000	21/12/2027	88 700	31	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	4,500	21/12/2027	150 900	(64)	(0,02)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,520	26/07/2026	ILS 24 300	(658)	(0,22)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,601	05/07/2026	2 800	77	0,03
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,628	25/06/2026	5 600	(140)	(0,05)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,692	13/09/2026	48 400	1 203	0,40
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,728	04/08/2026	4 100	(106)	(0,04)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,730	21/05/2026	3 500	85	0,03
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,750	10/12/2026	34 100	(899)	(0,30)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,900	07/10/2026	9 000	(227)	(0,08)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,905	25/11/2026	8 100	(217)	(0,07)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,965	14/01/2027	10 600	283	0,09
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,040	28/10/2026	10 400	(257)	(0,08)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,049	12/11/2026	12 000	282	0,09
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,105	21/01/2027	16 900	425	0,14
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,178	04/02/2027	13 800	335	0,11
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	2,183	06/05/2027	7 500	116	0,04
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	2,390	27/05/2027	11 400	159	0,05
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	2,666	18/07/2027	7 500	17	0,01
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	2,670	15/07/2027	34 800	(91)	(0,03)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	2,825	10/06/2027	10 900	(105)	(0,03)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,210	17/06/2027	1 900	21	0,01
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	3,260	18/11/2027	38 400	(68)	(0,02)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	3,290	16/11/2027	25 363	(23)	(0,01)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	3,530	03/04/2028	69 500	(196)	(0,06)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	3,590	31/03/2028	24 500	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	TELBOR ILS à 3 mois	3,590 %	18/05/2028	ILS 23 700	\$ 45	0,01
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,619	05/01/2028	27 400	(13)	0,00
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,650	02/01/2028	18 900	(17)	(0,01)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,670	30/12/2027	19 000	(80)	(0,03)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,720	21/10/2027	72 900	(271)	(0,09)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,980	23/02/2028	8 600	(45)	(0,01)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	4,030	24/02/2028	54 700	(455)	(0,15)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	4,130	03/03/2028	30 000	91	0,03
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	21/06/2028	KRW 25 301 100	127	0,04
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/03/2028	37 768 000	(630)	(0,21)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,500	15/03/2028	10 054 900	(140)	(0,05)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	3,500	15/03/2028	32 096 900	343	0,11
À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	15/03/2028	THB 397 700	142	0,05
À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	15/03/2028	382 200	(103)	(0,03)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	4,900	12/11/2025	ZAR 3 400	(15)	(0,01)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	4,938	18/09/2025	7 000	32	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	(42)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,375	27/05/2025	7 800	(40)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,601	09/06/2026	31 050	(124)	(0,04)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,680	08/06/2026	41 150	(167)	(0,06)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,739	28/07/2026	72 100	(292)	(0,10)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,780	03/03/2026	36 600	125	0,04
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,860	23/06/2026	75 600	273	0,09
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,950	17/03/2026	1 200	4	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,980	22/09/2026	43 900	164	0,05
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,023	01/07/2026	28 100	98	0,03
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,200	22/04/2025	7 600	(51)	(0,02)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,231	29/09/2026	55 400	185	0,06
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,300	23/12/2026	30 900	(108)	(0,04)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,320	23/04/2025	5 600	(38)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,400	30/12/2026	33 600	(112)	(0,04)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,540	04/01/2027	37 100	(120)	(0,04)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,540	23/02/2027	64 600	(213)	(0,07)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,670	12/01/2027	73 700	225	0,07
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,690	04/11/2026	2 000	6	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	(58)	(0,02)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,049	09/03/2027	70 000	173	0,06
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,489	18/05/2027	112 100	128	0,04
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,600	19/06/2024	7 100	56	0,02
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,705	10/01/2028	504 000	(962)	(0,32)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,710	06/05/2027	22 200	(1)	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,730	09/01/2028	119 300	(212)	(0,07)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,740	17/08/2027	63 300	(24)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,750	20/03/2024	9 180	(70)	(0,02)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,800	19/12/2023	3 100	(22)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,900	06/01/2028	119 300	(169)	(0,06)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,055	14/11/2027	8 400	(2)	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,064	27/07/2027	21 200	(46)	(0,02)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	8,120	13/03/2028	99 500	37	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	8,205	17/02/2028	241 300	202	0,07
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	8,430	23/02/2028	152 700	59	0,02
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	8,465	23/02/2028	240 400	75	0,02
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	8,500	17/10/2027	12 000	(1)	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	8,510	25/04/2028	262 000	69	0,02
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,560	25/04/2028	72 800	3	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	8,950	11/05/2028	67 000	(88)	(0,03)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	9,185	12/06/2028	87 400	(10)	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	9,350	18/05/2028	56 800	(55)	(0,02)
À recevoir ⁽³⁾	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,000	20/09/2025	AUD 102 900	167	0,06
À payer ⁽³⁾	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,500	20/09/2033	23 400	(66)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,570	09/07/2026	CLP 1 279 600	(157)	(0,05)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,728	20/08/2026	2 239 800	236	0,08
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,133	23/06/2028	3 579 500	(23)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,158	15/06/2028	7 959 600	(65)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,220	19/11/2026	2 363 300	(60)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,230	14/06/2028	1 732 400	(4)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,237	14/06/2028	2 356 600	(10)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,261	17/11/2027	3 774 600	(56)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,280	17/11/2027	3 854 600	(53)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,290	13/06/2028	1 707 900	1	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,293	21/03/2028	4 537 600	(97)	(0,03)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,300	17/11/2027	940 100	(10)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,300	22/03/2028	5 848 400	(122)	(0,04)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,358	18/11/2027	2 390 300	(19)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,420	28/10/2026	1 284 200	34	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,420	18/11/2027	7 201 400	(47)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,458	20/03/2028	7 549 300	(95)	(0,03)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,530	18/11/2027	2 406 700	2	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,620	22/10/2026	1 673 000	26	0,01

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	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,650 %	03/02/2028	CLP 5 748 800	\$ 70	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,650	01/06/2028	2 946 200	(45)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,699	01/06/2028	4 644 000	(84)	(0,03)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,780	31/05/2028	1 398 200	(31)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,798	31/05/2028	5 567 800	(129)	(0,04)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,830	25/04/2028	5 063 700	58	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,975	18/01/2027	1 912 300	28	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,000	16/02/2028	5 590 200	(58)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,207	31/05/2027	1 836 600	49	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,210	27/03/2026	10 738 200	(112)	(0,04)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,230	27/05/2027	1 675 600	44	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,370	03/03/2028	4 119 100	(142)	(0,05)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,380	03/03/2028	4 366 200	(153)	(0,05)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,385	07/03/2028	6 138 400	(222)	(0,07)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,490	06/03/2028	8 848 600	(369)	(0,12)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,885	13/05/2027	1 642 400	(85)	(0,03)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	21/10/2027	5 870 000	(409)	(0,14)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,161	17/06/2027	2 386 300	(174)	(0,06)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,174	17/06/2027	1 432 400	(109)	(0,04)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,420	09/09/2027	2 595 500	(206)	(0,07)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,900	30/09/2027	2 317 200	(250)	(0,08)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,421	15/05/2025	CZK 900	(3)	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,590	26/03/2025	10 900	(46)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,637	24/07/2025	7 700	(38)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,665	22/09/2025	5 100	(24)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,690	04/05/2025	4 100	(17)	(0,01)
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	(39)	(0,01)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,100	31/12/2025	57 000	256	0,08
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,124	13/03/2025	12 000	(58)	(0,02)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,570	09/03/2026	59 800	298	0,10
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,580	19/03/2026	51 600	237	0,08
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,715	23/07/2026	100 200	(494)	(0,16)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,775	04/06/2026	57 900	(256)	(0,08)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,934	02/07/2026	95 200	450	0,15
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,972	07/07/2026	55 500	266	0,09
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	2,015	10/08/2026	132 200	536	0,18
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	3,340	06/01/2032	171 700	(114)	(0,04)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	3,770	11/02/2027	72 000	(159)	(0,05)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,195	21/03/2033	125 300	(28)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,220	21/03/2033	67 600	(7)	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,300	18/03/2027	80 900	94	0,03
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,420	22/03/2028	172 600	(103)	(0,03)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,420	05/05/2032	9 700	(10)	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,420	01/06/2033	89 100	(25)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,440	12/12/2027	253 100	166	0,06
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,455	01/06/2033	90 400	(96)	(0,03)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,510	22/03/2028	151 800	(62)	(0,02)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,560	09/12/2027	156 700	140	0,05
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,630	21/03/2028	151 800	(26)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,640	07/12/2027	156 700	163	0,05
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,680	08/12/2027	156 700	178	0,06
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,695	04/05/2028	116 300	18	0,01
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,735	04/05/2028	95 500	23	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,070	20/04/2028	101 000	(86)	(0,03)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,090	20/04/2028	121 900	(109)	(0,04)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,103	16/11/2027	240 300	456	0,15
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,140	11/07/2027	58 000	85	0,03
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,175	11/07/2027	82 400	83	0,03
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,175	23/02/2028	48 100	(39)	(0,01)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,185	24/05/2027	64 000	(38)	(0,01)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,215	24/02/2028	249 500	(242)	(0,08)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,264	02/03/2028	224 100	(288)	(0,10)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,285	20/05/2027	83 300	(62)	(0,02)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,538	02/09/2027	52 400	(131)	(0,04)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,640	10/06/2027	3 400	(5)	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,740	03/10/2027	121 600	(372)	(0,12)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,788	20/10/2027	538 000	(1 910)	(0,63)
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	€ 300	(1)	0,00
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	19 300	(32)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	104 700	651	0,22
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,085	14/08/2025	HUF 186 300	112	0,04
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,115	08/01/2026	1 131 600	(790)	(0,26)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,220	15/01/2026	559 700	392	0,13
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,230	15/01/2026	872 700	612	0,20
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,920	16/04/2026	426 000	(255)	(0,08)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,958	19/03/2026	1 746 000	1 055	0,35
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,980	09/03/2026	646 300	400	0,13
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	2,499	05/07/2026	78 800	49	0,02
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	2,558	06/08/2026	1 156 900	676	0,22
À payer	BBR HUF à 6 mois	5,060	18/02/2027	885 100	(363)	(0,12)

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	BBR HUF à 6 mois	5,500 %	04/03/2027	HUF 627 800	\$ 226	0,07
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	6,100	11/03/2027	498 000	148	0,05
À payer	BBR HUF à 6 mois	7,480	03/06/2027	700 700	19	0,01
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	7,640	13/05/2027	721 400	72	0,02
À payer	BBR HUF à 6 mois	8,320	20/01/2028	729 300	(41)	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	8,500	25/01/2028	5 485 200	(38)	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	8,550	24/01/2028	1 174 900	(30)	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	8,650	19/01/2028	731 300	(13)	0,00
À payer	BBR HUF à 6 mois	8,740	28/04/2028	4 915 800	130	0,04
À payer	BBR HUF à 6 mois	8,800	27/04/2028	1 126 200	78	0,03
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	9,490	11/04/2028	2 501 700	(344)	(0,11)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	9,500	11/04/2028	1 025 500	(142)	(0,05)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	9,510	11/04/2028	1 038 900	(184)	(0,06)
À payer	BBR HUF à 6 mois	9,625	15/08/2027	695 900	234	0,08
À payer	BBR HUF à 6 mois	9,750	22/11/2027	283 976	83	0,03
À payer	BBR HUF à 6 mois	9,800	16/11/2027	2 235 924	655	0,22
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	9,900	16/12/2027	162 500	(54)	(0,02)
À payer	BBR HUF à 6 mois	10,000	18/11/2027	319 400	102	0,03
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	10,050	15/12/2027	164 000	(57)	(0,02)
À payer	BBR HUF à 6 mois	10,070	18/07/2027	428 900	109	0,04
À payer	BBR HUF à 6 mois	10,100	15/07/2027	488 900	125	0,04
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	10,340	15/12/2027	334 200	(128)	(0,04)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	11,140	23/12/2027	2 021 500	(932)	(0,31)
À payer	BBR HUF à 6 mois	11,350	11/11/2027	289 300	111	0,04
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	11,524	12/09/2027	2 052 600	(899)	(0,30)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	11,650	09/09/2027	359 200	(170)	(0,06)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	12,500	19/10/2027	4 079 400	(2 513)	(0,83)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,481	11/08/2025	PLN 3 400	(99)	(0,03)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,560	17/04/2025	1 900	(48)	(0,02)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,580	11/01/2026	8 500	(291)	(0,10)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,585	22/09/2025	6 000	(172)	(0,06)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,635	08/05/2025	1 100	(28)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	0,730	05/02/2026	6 500	217	0,07
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	0,890	12/02/2026	20 900	674	0,22
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,188	19/03/2026	17 800	493	0,16
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,229	09/03/2026	7 000	206	0,07
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,405	10/08/2026	27 100	767	0,25
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,450	05/07/2026	5 300	(165)	(0,05)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,465	07/06/2026	2 400	63	0,02
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	2,185	08/10/2026	8 300	(181)	(0,06)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	2,983	08/11/2026	20 100	276	0,09
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	3,525	24/12/2026	3 300	(29)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	3,600	27/12/2026	3 300	(26)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	3,739	03/01/2027	1 000	(15)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	3,934	04/03/2027	19 200	(95)	(0,03)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,219	04/02/2027	10 200	112	0,04
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,830	18/03/2027	2 000	8	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	4,930	29/06/2028	24 400	(16)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,179	01/04/2027	7 900	6	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,300	12/01/2028	23 800	11	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,430	16/03/2028	6 700	12	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,460	16/08/2027	1 300	(25)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,490	12/12/2027	19 700	211	0,07
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,525	12/12/2027	6 500	72	0,02
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,540	01/06/2028	26 800	(1)	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,670	09/12/2027	19 500	247	0,08
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,750	08/12/2027	16 300	221	0,07
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,800	07/12/2027	32 600	457	0,15
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,830	08/12/2027	32 600	470	0,16
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,160	23/02/2028	42 600	(449)	(0,15)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,310	18/11/2027	14 800	286	0,09
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,348	09/09/2027	14 800	(277)	(0,09)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,365	17/11/2027	15 600	310	0,10
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,455	16/11/2027	23 630	493	0,16
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,650	29/09/2027	33 200	(899)	(0,30)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	7,223	29/06/2027	23 200	319	0,11
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,726	24/10/2027	87 700	(2 886)	(0,95)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	7,761	21/10/2027	7 052	239	0,08
À recevoir	TAIBOR TWD à 6 mois	1,250	15/03/2028	TWD 861 000	3	0,00
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	4,775	26/06/2025	MXN 4 900	27	0,01
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	4,800	05/02/2026	65 500	336	0,11
À payer	TIE MXN à 28 jours	5,080	09/10/2025	14 500	(91)	(0,03)
À payer	TIE MXN à 28 jours	5,095	30/10/2025	23 500	(149)	(0,05)
À payer	TIE MXN à 28 jours	5,120	06/05/2025	15 800	(95)	(0,03)
À payer	TIE MXN à 28 jours	5,443	17/04/2025	5 700	(35)	(0,01)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	5,550	12/03/2026	32 800	171	0,06
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,050	04/06/2026	22 600	(104)	(0,03)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	6,095	20/03/2026	51 800	231	0,08
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,210	28/03/2025	4 300	(29)	(0,01)
À payer	TIE MXN à 28 jours	6,230	07/04/2025	16 700	(118)	(0,04)
À recevoir	TIE MXN à 28 jours	6,255	21/05/2026	23 500	98	0,03

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	TIIE MXN à 28 jours	6,460 %	18/06/2026	MXN 43 000	\$ 159	0,05
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,625	11/09/2026	21 100	78	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,635	11/09/2026	21 100	77	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,740	17/09/2026	28 500	98	0,03
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,109	03/12/2026	102 300	(296)	(0,10)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,113	24/09/2026	134 600	403	0,13
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,264	17/12/2026	30 000	82	0,03
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,273	12/11/2026	33 880	(87)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,353	05/11/2026	58 150	145	0,05
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,370	14/10/2026	24 200	(59)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,383	28/01/2027	29 500	71	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,460	04/02/2027	44 800	(99)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,530	14/01/2027	24 100	54	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,590	29/10/2026	40 000	85	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,673	31/12/2026	23 900	45	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,745	11/02/2027	53 100	(97)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,055	13/06/2033	57 100	(29)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,207	19/06/2028	135 000	(44)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,250	02/12/2032	85 900	17	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,280	29/07/2027	40 300	(38)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,281	28/03/2033	68 000	44	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,340	21/04/2033	35 500	(57)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,374	14/03/2033	135 600	146	0,05
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,400	21/05/2027	47 400	(19)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,402	20/05/2027	34 800	(14)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,438	20/03/2028	307 500	22	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,453	30/11/2027	332 600	(10)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,480	30/11/2027	105 200	3	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,498	11/03/2027	25 400	(10)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,563	16/05/2033	31 700	(59)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,616	05/11/2027	165 400	48	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,620	09/11/2027	82 900	55	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,728	22/05/2028	135 300	(116)	(0,04)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,740	30/08/2027	30 800	(19)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,755	03/02/2033	45 900	(114)	(0,04)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,785	06/05/2027	24 900	(6)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,800	02/02/2033	73 500	(195)	(0,06)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,810	01/07/2027	60 100	24	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,844	07/02/2033	104 900	(299)	(0,10)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,921	25/08/2027	61 100	(34)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,940	07/02/2028	136 200	(146)	(0,05)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,020	03/06/2027	91 300	(78)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,060	14/09/2027	61 100	(75)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,070	24/06/2027	13 500	(13)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,114	24/06/2027	11 700	(12)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,215	09/02/2028	146 800	(250)	(0,08)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,290	23/09/2027	22 500	35	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,295	21/10/2027	116 100	(191)	(0,06)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,300	24/09/2027	34 400	54	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,345	16/02/2028	99 400	(202)	(0,07)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,382	12/10/2027	153 800	(289)	(0,10)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,390	07/10/2027	40 300	(74)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,536	22/09/2027	67 800	(140)	(0,05)
À payer	CPURNSA	2,525	07/06/2033	\$ 4 200	(10)	0,00
					\$ (5 452)	(1,81)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ (5 126)	(1,70)

(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.

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
DUB	Option de vente - USD contre JPY hors cote	¥ 125.000	25/07/2023	20 000	\$ 2	\$ 1	0,00
RBC	Option d'achat - USD contre CAD hors cote	CAD 1,383	20/07/2023	6 000	1	0	0,00
					\$ 3	\$ 1	0,00

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

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 %	15/03/2028	MYR 55 000	\$ (47)	\$ 129	\$ 82	0,03
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/12/2027	143 400	98	30	128	0,04
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	125 700	(76)	(36)	(112)	(0,04)
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	5 100	6	2	8	0,00
GST	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	55 300	169	(120)	49	0,02
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	4,000	21/12/2027	39 700	131	(256)	(125)	(0,04)
JPM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/03/2028	24 800	23	14	37	0,01
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/12/2027	86 500	103	(26)	77	0,03
MYC	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	49 800	(1)	(44)	(45)	(0,02)
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	4,000	21/12/2027	47 600	101	(251)	(150)	(0,05)
SCX	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/12/2027	40 300	46	(10)	36	0,01
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	4,250	21/12/2027	38 980	13	198	211	0,07
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	2 100	(3)	1	(2)	0,00
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	15/03/2028	33 500	29	1	30	0,01
						\$ 592	\$ (368)	\$ 224	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
MEI	À recevoir	Indice BOVESPA Index	195	0,000 %	BRL 23 509	16/08/2023	\$ 0	\$ (28)	\$ (28)	(0,01)
	À recevoir	Indice KOSPI2 Index	32 000 000	0,000	KRW 11 068 163	14/09/2023	0	(131)	(131)	(0,04)
	À payer	Indice Thailand Equity Index	270 400	0,000	THB 244 719	28/09/2023	0	(73)	(73)	(0,03)
						\$ 0	\$ (232)	\$ (232)	(0,08)	

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	07/2023	\$ 3 216	¥ 431 000	\$ 0	\$ (232)	\$ (232)	(0,08)
	08/2023	6 410	AUD 9 562	0	(37)	(37)	(0,01)
BOA	07/2023	CLP 92 793	\$ 115	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	IDR 61 808 103	4 131	9	0	9	0,00
GLM	07/2023	PLN 1 643	397	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	TRY 3 063	138	21	0	21	0,01
GST	07/2023	\$ 6	CZK 121	0	0	0	0,00
	07/2023	4 113	IDR 61 808 103	9	0	9	0,00
JPM	07/2023	279	PLN 1 172	9	0	9	0,00
	07/2023	77	TRY 1 837	0	(7)	(7)	0,00
MYC	08/2023	AUD 37 031	\$ 25 029	352	(2)	350	0,12
	08/2023	CAD 4 164	3 102	0	(46)	(46)	(0,02)
SCX	08/2023	£ 1 721	2 151	0	(39)	(39)	(0,01)
	08/2023	¥ 1 786 900	12 893	451	0	451	0,15
BPS	08/2023	NZD 19 475	12 129	200	0	200	0,07
	08/2023	SEK 69 738	6 783	314	0	314	0,10
BOA	08/2023	\$ 859	AUD 1 306	14	(2)	12	0,00
	08/2023	708	CAD 940	3	0	3	0,00
GLM	08/2023	3 297	€ 3 066	55	0	55	0,02
	08/2023	126	£ 101	2	0	2	0,00
GST	08/2023	122	¥ 16 400	0	(8)	(8)	0,00
	08/2023	19	SEK 205	0	0	0	0,00
JPM	08/2023	ZAR 7 012	\$ 372	4	(2)	2	0,00
	09/2023	HKD 12 697	1 625	2	0	2	0,00
MYC	09/2023	IDR 24 088 000	1 600	0	0	0	0,00
	09/2023	INR 1 929 851	23 480	22	0	22	0,01
SCX	09/2023	KRW 640 033	505	17	0	17	0,01
	09/2023	TWD 45 097	1 487	36	0	36	0,01
BPS	09/2023	\$ 4 131	IDR 61 857 680	0	(23)	(23)	(0,01)
	11/2023	28	ILS 100	0	0	0	0,00
BOA	07/2023	BRL 11 493	\$ 2 340	0	(42)	(42)	(0,01)
	07/2023	PLN 460	107	0	(6)	(6)	0,00
GLM	07/2023	SGD 614	463	9	0	9	0,00
	07/2023	TRY 329	14	2	0	2	0,00
GST	07/2023	\$ 4	CLP 2 938	0	0	0	0,00
	07/2023	63	COP 262 528	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07/2023	5 634	CZK 120 532	0	(103)	(103)	(0,03)
	07/2023	380	PLN 1 586	10	0	10	0,00
MYC	07/2023	15	SGD 20	0	0	0	0,00
	07/2023	9	TRY 196	0	(1)	(1)	0,00
SCX	08/2023	AUD 487	\$ 331	7	0	7	0,00
	08/2023	CAD 1 757	1 300	0	(29)	(29)	(0,01)
BPS	08/2023	CHF 17 730	20 073	170	0	170	0,06
	08/2023	CNH 7 386	1 069	50	0	50	0,02
GLM	08/2023	€ 6 600	7 122	2	(100)	(94)	(0,03)
	08/2023	SEK 2 655	248	2	0	2	0,00
GST	08/2023	TWD 23 310	763	15	0	15	0,01

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
	08/2023	\$ 1 045	AUD 1 538	\$ 0	\$ (20)	\$ (20)	(0,01)
	08/2023	524	€ 486	7	0	7	0,00
	08/2023	334	¥ 46 300	0	(12)	(12)	0,00
	08/2023	2 502	MXN 43 559	17	0	17	0,01
	08/2023	95	ZAR 1 776	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	ZAR 888	\$ 46	0	0	0	0,00
	09/2023	AUD 3 700	2 449	0	(19)	(19)	(0,01)
	09/2023	BRL 5 970	1 200	0	(21)	(21)	(0,01)
	09/2023	CLP 940 367	1 151	0	(10)	(10)	0,00
	09/2023	COP 262 528	62	1	0	1	0,00
	09/2023	¥ 627 327	4 500	108	0	108	0,04
	09/2023	KRW 2 750 742	2 137	40	0	40	0,01
	09/2023	PLN 14 040	3 300	0	(143)	(143)	(0,05)
	09/2023	RON 11 139	2 400	0	(45)	(45)	(0,01)
	09/2023	SEK 13 610	1 258	0	(7)	(7)	0,00
	09/2023	THB 641 340	18 621	395	0	395	0,13
	09/2023	\$ 6 791	AUD 10 000	0	(120)	(120)	(0,04)
	09/2023	1 300	BRL 6 416	12	0	12	0,00
	09/2023	12 500	CAD 16 638	88	0	88	0,03
	09/2023	1 300	COP 5 885 100	81	0	81	0,03
	09/2023	5 349	€ 4 875	0	(10)	(10)	0,00
	09/2023	13 728	£ 10 688	0	(138)	(138)	(0,05)
	09/2023	910	HUF 313 488	0	(10)	(10)	0,00
	09/2023	5 583	ILS 19 917	0	(201)	(201)	(0,07)
	09/2023	9 100	KRW 11 708 485	0	(176)	(176)	(0,06)
	09/2023	5 225	NZD 8 400	0	(80)	(80)	(0,03)
	09/2023	1 400	PLN 5 722	3	0	3	0,00
	09/2023	3 311	RON 15 030	0	(12)	(12)	0,00
	09/2023	14 406	THB 493 710	0	(377)	(377)	(0,12)
	09/2023	5 364	ZAR 99 481	0	(139)	(139)	(0,05)
BRC	12/2023	MXN 383 334	\$ 21 501	0	(187)	(187)	(0,06)
	07/2023	CZK 52 677	2 384	0	(34)	(34)	(0,01)
	07/2023	¥ 1 370 000	10 592	1 096	0	1 096	0,36
	07/2023	MYR 66 031	14 392	218	0	218	0,07
	07/2023	SGD 453	337	3	0	3	0,00
	07/2023	TRY 1 434	60	5	0	5	0,00
	07/2023	\$ 6 480	PLN 26 895	134	0	134	0,04
	07/2023	1 771	RON 8 150	21	0	21	0,01
	07/2023	56	SGD 75	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	COP 3 274 264	\$ 769	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	£ 15 617	19 487	0	(373)	(373)	(0,12)
	08/2023	HUF 686 424	1 978	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023	¥ 322 368	2 436	191	0	191	0,06
	08/2023	\$ 17 159	CNH 122 253	0	(300)	(300)	(0,10)
	08/2023	4 353	€ 4 015	36	0	36	0,01
	08/2023	538	£ 427	6	(1)	5	0,00
	08/2023	90	¥ 12 200	0	(5)	(5)	0,00
	08/2023	78	MXN 1 352	0	0	0	0,00
	08/2023	156	ZAR 3 021	4	(1)	3	0,00
	08/2023	ZAR 1 299	\$ 68	0	(1)	(1)	0,00
	09/2023	HKD 7 899	1 011	1	0	1	0,00
	09/2023	ILS 14 703	4 137	164	0	164	0,05
	09/2023	SGD 2 683	2 009	21	0	21	0,01
	09/2023	\$ 113	HKD 886	0	0	0	0,00
	09/2023	2 000	ILS 7 236	0	(45)	(45)	(0,01)
	09/2023	3 300	KRW 4 275 150	0	(42)	(42)	(0,01)
CBK	07/2023	BRL 12 668	\$ 2 640	14	0	14	0,01
	07/2023	€ 1 272	1 365	0	(23)	(23)	(0,01)
	07/2023	IDR 47 763 202	3 179	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	MXN 1 059	59	0	(3)	(3)	0,00
	07/2023	RON 14 639	3 238	19	0	19	0,01
	07/2023	TRY 1 924	85	11	0	11	0,00
	07/2023	\$ 1 763	CLP 1 426 848	14	0	14	0,00
	07/2023	646	CZK 13 928	0	(7)	(7)	0,00
	07/2023	3 179	IDR 47 763 202	7	0	7	0,00
	07/2023	18 900	INR 1 551 407	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	16 672	PHP 909 467	0	(230)	(230)	(0,08)
	07/2023	33	PLN 133	0	0	0	0,00
	08/2023	CAD 1 688	\$ 1 254	0	(23)	(23)	(0,01)
	08/2023	CLP 2 024 098	2 474	0	(31)	(31)	(0,01)
	08/2023	CNH 220 848	31 676	1 220	0	1 220	0,40
	08/2023	¥ 339 412	2 554	191	0	191	0,06
	08/2023	NOK 8 659	830	21	0	21	0,01
	08/2023	SEK 22 976	2 266	134	0	134	0,04
	08/2023	TWD 55 070	1 804	36	0	36	0,01
	08/2023	\$ 173	AUD 262	2	0	2	0,00
	08/2023	13 266	CLP 10 669 473	0	(23)	(23)	(0,01)
	08/2023	579	€ 538	10	0	10	0,00
	08/2023	27 504	£ 21 737	138	0	138	0,05
	08/2023	698	¥ 95 800	0	(31)	(31)	(0,01)
	08/2023	73	SEK 765	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	2 757	TWD 84 415	0	(47)	(47)	(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	
	08/2023	\$	169	ZAR 3 177	\$ 0	\$ (2)	(2)	0,00
	09/2023	COP 6 025 600	\$ 1 400	\$ 1 400	0	(14)	(14)	0,00
	09/2023	IDR 21 721		1	0	0	0	0,00
	09/2023	INR 62 165		756	1	0	1	0,00
	09/2023	MXN 26 102		1 500	0	0	0	0,00
	09/2023	PEN 38 818		10 548	0	(97)	(97)	(0,03)
	09/2023	SEK 13 203		1 221	0	(6)	(6)	0,00
	09/2023	\$ 2 611	BRL 12 668	0	0	(14)	(14)	0,00
	09/2023	4 259	IDR 63 902 621	0	0	(15)	(15)	(0,01)
	09/2023	13	ILS 48	0	0	0	0	0,00
	09/2023	4 260	NOK 44 774	0	0	(70)	(70)	(0,02)
	09/2023	ZAR 12 167	\$ 658	19	19	0	19	0,01
	10/2023	\$ 1 187	CLP 969 447	7	0	7	7	0,00
	11/2023	ILS 98	\$ 30	3	0	3	3	0,00
	04/2024	100		28	0	0	0	0,00
DUB	07/2023	MXN 35 716		2 080	1	0	1	0,00
	07/2023	\$ 844	BRL 4 570	104	0	104	104	0,03
	07/2023	133	CZK 2 947	2	0	2	2	0,00
	08/2023	€ 920	\$ 1 004	0	(1)	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$ 22 495	CHF 20 171	149	0	149	149	0,05
	08/2023	302	£ 243	7	0	7	7	0,00
	08/2023	34	SEK 360	0	0	0	0	0,00
	08/2023	34	ZAR 647	0	0	0	0	0,00
FAR	09/2023	3 360	HUF 1 156 833	0	(39)	(39)	(39)	(0,01)
	07/2023	1 828	CLP 1 450 837	0	(21)	(21)	(21)	(0,01)
GLM	08/2023	51	£ 41	1	0	1	1	0,00
	07/2023	COP 24 235 035	\$ 5 742	0	(48)	(48)	(48)	(0,02)
	07/2023	PHP 102	2	0	0	0	0	0,00
	07/2023	PLN 1 686	397	0	(17)	(17)	(17)	(0,01)
	07/2023	SGD 5 942	4 476	83	0	83	83	0,03
	07/2023	\$ 803	BRL 4 293	87	0	87	87	0,03
	07/2023	8	RON 36	0	0	0	0	0,00
	08/2023	CHF 2 217	\$ 2 505	16	0	16	16	0,01
	08/2023	NOK 16 616	1 566	13	0	13	13	0,00
	09/2023	BRL 33	6	0	0	0	0	0,00
	09/2023	SGD 406	304	3	0	3	3	0,00
	09/2023	\$ 10 190	BRL 51 385	344	0	344	344	0,11
	09/2023	1 476	MXN 25 802	6	0	6	6	0,00
	09/2023	147	SGD 196	0	(1)	(1)	(1)	0,00
IND	10/2023	MXN 20 762	\$ 1 183	0	(5)	(5)	(5)	0,00
	07/2023	\$ 28 296	¥ 3 784 000	0	(2 041)	(2 041)	(2 041)	(0,67)
	07/2023	41	SGD 55	0	0	0	0	0,00
	08/2023	£ 1 710	\$ 2 135	0	(40)	(40)	(40)	(0,01)
JPM	08/2023	NOK 6 834	652	13	0	13	13	0,00
	07/2023	431	25	0	0	0	0	0,00
	07/2023	SGD 2 086	1 579	37	0	37	37	0,01
	07/2023	TRY 6 350	276	34	0	34	34	0,01
	07/2023	\$ 1 089	PHP 59 517	0	(13)	(13)	(13)	0,00
	07/2023	62	PLN 264	3	0	3	3	0,00
	07/2023	22	SGD 30	0	0	0	0	0,00
	07/2023	178	TRY 4 085	0	(22)	(22)	(22)	(0,01)
	08/2023	CAD 2 631	1 968	0	(22)	(22)	(22)	(0,01)
	08/2023	CNH 18 874	2 731	128	0	128	128	0,04
	08/2023	€ 1 034	1 139	9	0	9	9	0,00
	08/2023	£ 760	962	0	(4)	(4)	(4)	0,00
	08/2023	¥ 339 295	2 554	192	0	192	192	0,06
	08/2023	MXN 2 041	118	0	0	0	0	0,00
	08/2023	NOK 22 739	2 144	18	0	18	18	0,01
	08/2023	68	AUD 102	0	0	0	0	0,00
	08/2023	1 246	CAD 1 687	30	0	30	30	0,01
	08/2023	228	€ 211	2	0	2	2	0,00
	08/2023	1 094	£ 875	21	(2)	19	19	0,01
	08/2023	6 111	HUF 2 106 276	2	(28)	(26)	(26)	(0,01)
	08/2023	12	¥ 1 600	0	(1)	(1)	(1)	0,00
	08/2023	8 951	NZD 14 500	0	(70)	(70)	(70)	(0,02)
	09/2023	CHF 9 615	\$ 10 700	0	(134)	(134)	(134)	(0,04)
	09/2023	COP 1 109 099	261	1	0	1	1	0,00
	09/2023	CZK 26 554	1 200	0	(15)	(15)	(15)	(0,01)
	09/2023	HKD 4 038	517	1	0	1	1	0,00
	09/2023	IDR 47 568 000	3 200	40	0	40	40	0,01
	09/2023	ILS 3 629	1 022	41	0	41	41	0,01
	09/2023	INR 133 502	1 620	0	(3)	(3)	(3)	0,00
	09/2023	PHP 619 377	11 014	0	(164)	(164)	(164)	(0,05)
	09/2023	SEK 13 206	1 221	0	(6)	(6)	(6)	0,00
	09/2023	THB 177 650	5 109	61	0	61	61	0,02
	09/2023	\$ 1 377	AUD 2 000	0	(42)	(42)	(42)	(0,01)
	09/2023	1 187	BRL 5 998	43	0	43	43	0,01
	09/2023	1 700	CLP 1 386 180	12	0	12	12	0,00
	09/2023	30	HUF 10 325	0	0	0	0	0,00
	09/2023	1 075	IDR 16 138 617	0	(3)	(3)	(3)	0,00
	09/2023	1 000	ILS 3 549	0	(41)	(41)	(41)	(0,01)
	09/2023	7 123	INR 589 620	44	0	44	44	0,01

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				
	09/2023	\$	2 003	KRW	2 538 382	\$	0	\$	(68)	(68)	(0,02)
	09/2023		1 600	MXN	28 316		27		0	27	0,01
	09/2023		1 540	NOK	16 154		0		(28)	(28)	(0,01)
	09/2023		20 139	PEN	74 151		195		0	195	0,06
	09/2023		2	PHP	133		0		0	0	0,00
	09/2023		60	SGD	80		0		(1)	(1)	0,00
	09/2023		2 136	ZAR	40 075		0		(31)	(31)	(0,01)
MBC	07/2023	CZK	4 349	\$	202		2		0	2	0,00
	07/2023	£	736		911		0		(25)	(25)	(0,01)
	07/2023	¥	3 784 000		28 974		2 720		0	2 720	0,90
	07/2023	PLN	12 381		2 899		0		(146)	(146)	(0,05)
	07/2023	\$	5 961	¥	850 000		0		(69)	(69)	(0,02)
	07/2023		53	PLN	219		1		0	1	0,00
	07/2023		140	SGD	188		0		(1)	(1)	0,00
	08/2023	€	800	\$	883		8		0	8	0,00
	08/2023	TWD	286 896		9 385		171		0	171	0,06
	08/2023	\$	3 011	AUD	4 425		0		(62)	(62)	(0,02)
	08/2023		21 100	CAD	28 022		90		0	90	0,03
	09/2023	KRW	2 078 511	\$	1 630		46		0	46	0,02
MYI	09/2023	\$	109	HKD	854		0		0	0	0,00
	07/2023	CZK	7 881	\$	358		1		(4)	(3)	0,00
	07/2023	IDR	3 527 922		236		1		0	1	0,00
	07/2023	INR	1 551 690		18 900		2		0	2	0,00
	07/2023	MYR	22 010		4 781		57		0	57	0,02
	07/2023	TRY	6 741		277		20		0	20	0,01
	07/2023	\$	20	CZK	425		0		0	0	0,00
	07/2023		13	€	12		0		0	0	0,00
	07/2023		539	£	427		4		0	4	0,00
	07/2023		235	IDR	3 527 922		1		0	1	0,00
	07/2023		9 602	MYR	44 219		0		(111)	(111)	(0,04)
	07/2023		825	PLN	3 480		31		0	31	0,01
	07/2023		23	TRY	597		0		0	0	0,00
	08/2023	CAD	393	\$	295		0		(3)	(3)	0,00
	08/2023	¥	140 647		1 058		79		0	79	0,03
	08/2023	NOK	27 285		2 577		26		0	26	0,01
	08/2023	SEK	4 010		374		2		0	2	0,00
	08/2023	TWD	30 532		1 002		22		0	22	0,01
	08/2023	\$	539	CAD	719		4		0	4	0,00
	08/2023		42	€	39		0		0	0	0,00
	08/2023		926	¥	128 000		0		(35)	(35)	(0,01)
	08/2023		196	SEK	2 105		0		(1)	(1)	0,00
	09/2023	BRL	4 919	\$	1 000		0		(6)	(6)	0,00
	09/2023	ILS	29 483		8 218		251		0	251	0,08
	09/2023	KRW	4 418 771		3 453		85		0	85	0,03
	09/2023	THB	151 234		4 339		41		0	41	0,01
	09/2023	TRY	3 180		119		0		0	0	0,00
	09/2023	\$	6 900	CAD	9 118		8		(9)	(1)	0,00
	09/2023		35	HKD	273		0		0	0	0,00
	09/2023		236	IDR	3 530 989		0		(1)	(1)	0,00
	09/2023		19 790	INR	1 628 172		2		(1)	1	0,00
	09/2023		1 800	MXN	31 471		8		0	8	0,00
RBC	09/2023	ZAR	40 005	\$	2 149		48		0	48	0,02
	07/2023	\$	33 700	MXN	648 426		4 043		0	4 043	1,34
	07/2023		148	SGD	200		0		0	0	0,00
	08/2023	CAD	28 835	\$	21 364		0		(442)	(442)	(0,15)
	08/2023	£	1 271		1 606		0		(10)	(10)	0,00
	08/2023	¥	2 354 758		17 524		1 128		0	1 128	0,37
	08/2023	\$	83	AUD	123		0		(1)	(1)	0,00
	08/2023		45	€	41		0		0	0	0,00
	08/2023		224	£	180		4		0	4	0,00
	08/2023		148	MXN	2 566		0		0	0	0,00
RYL	07/2023	PLN	7 368	\$	1 738		0		(74)	(74)	(0,02)
	08/2023	SEK	1 820		168		0		0	0	0,00
	08/2023	\$	88	AUD	132		0		0	0	0,00
	08/2023		60	SEK	635		0		(1)	(1)	0,00
SCX	07/2023	SGD	1 949	\$	1 441		0		0	0	0,00
	07/2023	TRY	4 527		195		23		0	23	0,01
	07/2023	\$	2 032	PLN	8 649		95		0	95	0,03
	08/2023	AUD	19 492	\$	13 065		83		(8)	75	0,03
	08/2023	CNH	12 802		1 861		95		0	95	0,03
	08/2023	€	1 839		2 013		2		0	2	0,00
	08/2023	£	534		676		0		(3)	(3)	0,00
	08/2023	NZD	3 425		2 138		40		0	40	0,01
	08/2023	SEK	15 610		1 465		17		0	17	0,01
	08/2023	TWD	18 509		606		12		0	12	0,00
	08/2023	\$	159	AUD	238		0		0	0	0,00
	08/2023		962	€	890		11		0	11	0,00
	08/2023		3 858	£	3 095		78		0	78	0,03
	08/2023		441	NOK	4 685		0		(3)	(3)	0,00
	08/2023		99	SEK	1 030		0		(4)	(4)	0,00
	09/2023	INR	85 880	\$	1 043		0		(1)	(1)	0,00
	09/2023	THB	98 370		2 831		36		0	36	0,01
	09/2023	TWD	211 516		6 938		132		0	132	0,04
SOG	09/2023	\$	18 310	INR	1 505 832		0		(6)	(6)	0,00
	07/2023	PLN	3 511	\$	815		0		(48)	(48)	(0,02)
	07/2023	SGD	145		109		2		0	2	0,00
	07/2023	\$	1 229	SGD	1 649		0		(10)	(10)	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
SSB	08/2023	\$ 77	SEK 840	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	3 046	BRL 15 298	126	0	126	0,04
	07/2023	115	CLP 92 793	0	0	0	0,00
	07/2023	15 353	COP 68 133 777	964	0	964	0,32
	08/2023	CLP 34 068 674	\$ 42 019	0	(303)	(303)	(0,10)
	09/2023	1 100 110	1 349	0	(10)	(10)	0,00
	09/2023	\$ 39 508	CLP 31 930 100	0	(48)	(48)	(0,02)
	10/2023	CLP 92 793	\$ 114	0	0	0	0,00
	07/2023	COP 69 311 116	16 709	121	(10)	111	0,04
	07/2023	\$ 16 501	COP 68 954 036	0	(98)	(98)	(0,03)
TOR	07/2023	50	CZK 1 077	0	0	0	0,00
	07/2023	935	£ 736	0	0	0	0,00
	07/2023	151	PLN 842	7	0	7	0,00
	08/2023	€ 336	\$ 367	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	£ 1 597	2 014	0	(17)	(17)	(0,01)
	08/2023	¥ 167 426	1 263	97	0	97	0,03
	08/2023	\$ 1 934	CLP 1 552 352	0	(8)	(8)	0,00
	08/2023	21	£ 17	0	0	0	0,00
	08/2023	62	SEK 670	0	0	0	0,00
	09/2023	ILS 20 507	\$ 5 782	241	0	241	0,08
	09/2023	\$ 52	ILS 185	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	134	SGD 180	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	CZK 1 724	\$ 78	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	¥ 431 000	3 288	304	0	304	0,10
	07/2023	TRY 29 091	1 278	170	0	170	0,06
	07/2023	\$ 17	CZK 362	0	0	0	0,00
	07/2023	1 406	TRY 32 420	0	(171)	(171)	(0,06)
	08/2023	CAD 419	\$ 319	2	0	2	0,00
	08/2023	€ 1 084	1 190	5	0	5	0,00
08/2023	£ 429	542	0	(3)	(3)	0,00	
08/2023	¥ 1 360 000	10 033	577	0	577	0,19	
08/2023	\$ 150	€ 140	3	0	3	0,00	
08/2023	501	£ 396	2	0	2	0,00	
08/2023	1 831	HUF 638 347	13	0	13	0,00	
08/2023	1	TWD 43	0	0	0	0,00	
08/2023	ZAR 67 072	\$ 3 478	1	(59)	(58)	(0,02)	
09/2023	ILS 3 682	1 028	33	0	33	0,01	
09/2023	\$ 2 889	RON 13 121	0	(8)	(8)	0,00	
				\$ 20 258	\$ (8 618)	\$ 11 640	3,85

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 204	\$ 221	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$ 16 469	€ 15 324	250	0	250	0,08
BPS	07/2023	€ 15 732	\$ 17 238	74	0	74	0,02
	07/2023	\$ 17 543	€ 16 307	249	(2)	247	0,08
CBK	08/2023	€ 17 218	\$ 15 692	0	(73)	(73)	(0,02)
	07/2023	€ 16 073	\$ 17 476	1	(61)	(60)	(0,02)
JPM	07/2023	\$ 664	€ 619	11	0	11	0,00
	08/2023	€ 17 176	\$ 15 776	59	0	59	0,02
MBC	07/2023	€ 15 776	\$ 17 225	14	0	14	0,01
	08/2023	\$ 17 250	€ 15 776	0	(15)	(15)	0,00
SOG	07/2023	€ 322	\$ 346	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	\$ 458	€ 427	8	0	8	0,00
		16 778	15 597	238	0	238	0,08
				\$ 904	\$ (158)	\$ 746	0,25

Au 30 juin 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	07/2023	£ 2 565	\$ 3 266	\$ 5	\$ (1)	\$ 4	0,00
	07/2023	\$ 1 064	£ 854	22	0	22	0,01
CBK	07/2023	£ 24	\$ 31	0	0	0	0,00
	07/2023	2 372	3 017	1	0	1	0,00
MYI	07/2023	\$ 28 971	£ 23 403	783	0	783	0,26
	07/2023	£ 106	\$ 131	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07/2023	\$ 29 076	£ 23 394	666	0	666	0,22
	07/2023	29 959	24 027	594	(5)	589	0,19
				\$ 2 071	\$ (9)	\$ 2 062	0,68
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ 14 441	4,77

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy 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 5,500 % éch. 01/08/2053	\$ 17 200	\$ (17 113)	(5,66)
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/07/2038	4 800	(4 707)	(1,55)
5,500 % éch. 01/07/2053 (d)	2 850	(2 836)	(0,94)
5,500 % éch. 01/08/2053	3 000	(2 985)	(0,99)
6,000 % éch. 01/07/2053	160	(161)	(0,05)
6,000 % éch. 01/08/2053	3 740	(3 773)	(1,25)
Total des Titres vendus à découvert		\$ (31 575)	(10,44)
Total des Investissements		\$ 253 207	83,74
Autres actifs et passifs à court terme		\$ 49 157	16,26
Actifs nets		\$ 302 364	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) Le titre vendu à découvert au 30 juin 2023 est couvert par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(e) 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
DBS Bank Ltd.	4,467 %	22/11/2023	06/02/2023	\$ 4 805	\$ 4 660	1,54
Deutsche Bank AG	0,898	28/05/2024	31/03/2022 - 31/05/2023	2 408	2 376	0,79
MUFG Bank Ltd.	4,883	21/12/2023	06/02/2023 - 08/02/2023	1 037	999	0,33
				\$ 8 250	\$ 8 035	2,66

Un montant en numéraire de 26 089 \$ (31 décembre 2022 : 21 987 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 3 311 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 237 254	\$ 0	\$ 237 254
Fonds d'investissement	30 015	0	0	30 015
Contrats de mise en pension	0	4 583	0	4 583
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	2 979	9 951	0	12 930
Titres vendus à découvert	0	(31 575)	0	(31 575)
Totaux	\$ 32 994	\$ 220 213	\$ 0	\$ 253 207

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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ (269)	\$ 270	\$ 1	\$ S/O	\$ S/O	\$ S/O
BOA	1 730	(2 120)	(390)	(475)	490	15
BPS	(740)	920	180	(159)	380	221
BRC	1 112	(1 110)	2	(2 750)	2 340	(410)
CBK	1 206	(940)	266	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	224	(300)	(76)	S/O	S/O	S/O
FAR	(20)	0	(20)	S/O	S/O	S/O
GLM	413	(420)	(7)	(251)	330	79
GST	(81)	261	180	(299)	261	(38)
HUS	S/O	S/O	S/O	267	(260)	7
IND	(2 068)	1 860	(208)	(8)	0	(8)
JPM	278	(290)	(12)	153	(390)	(237)
MBC	3 521	(3 370)	151	931	(880)	51
MEI	(232)	0	(232)	(165)	450	285
MYC	211	(280)	(69)	204	0	204
MYI	1 185	(890)	295	(99)	120	21
RBC	4 722	(4 670)	52	(69)	50	(19)
RYL	(75)	0	(75)	(21)	0	(21)
SCX	627	(690)	(63)	1 408	(1 310)	98
SOG	182	(280)	(98)	1	0	1
SSB	729	(740)	(11)	38	0	38
TOR	329	(280)	49	(1 737)	1 620	(117)
UAG	1 457	(1 260)	197	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	45,34	28,54
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	33,13	48,50
Fonds d'investissement	9,93	9,56
Contrats de mise en pension	1,52	6,30
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	1,19	0,13
Instruments financiers dérivés compensés	(1,70)	(0,06)
Instruments financiers dérivés hors cote	4,77	(0,42)
Titres vendus à découvert	(10,44)	S/O
Certificats de dépôt	S/O	0,14

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Obligations et billets privés	55,27	39,15
Obligations et billets municipaux	S/O	0,23
Agences du gouvernement américain	2,36	1,39
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	0,62	0,45
Titres adossés à des actifs	4,21	1,06
Émissions souveraines	3,08	0,53
Instruments à court terme	12,93	34,23
Fonds d'investissement	9,93	9,56
Contrats de mise en pension	1,52	6,30
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	1,19	0,13
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,11	0,09
Swaps de taux d'intérêt	(1,81)	(0,15)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	0,00	S/O
Swaps de taux d'intérêt	0,07	0,04
Swaps de rendement total sur indices	(0,08)	(0,04)
Contrats de change à terme	3,85	(1,20)
Contrats de change à terme couverts	0,93	0,78
Certificats de dépôt		
Titres vendus à découvert	(10,44)	S/O
Autres actifs et passifs à court terme	16,26	7,31
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	
SUISSE				ROYAUME-UNI				SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse AG	£	1 400	0,42	3i Group PLC		850	0,18	NatWest Group PLC	£	1 800	0,44	
7,750 % éch. 10/03/2026				3,750 % éch. 05/06/2040				2,057 % éch. 09/11/2028			0,14	
UBS AG	\$	500	0,12	Anchor Hanover Group		400	0,06	2,875 % éch. 19/09/2026		500	0,13	
5,125 % éch. 15/05/2024 (f)				2,000 % éch. 21/07/2051				3,125 % éch. 28/03/2027		500	0,23	
UBS Group AG	€	300	0,07	Anglian Water Services Financing PLC		800	0,20	3,619 % éch. 29/03/2029		900	0,27	
0,250 % éch. 29/01/2026				2,750 % éch. 26/10/2029				5,125 % éch. 12/05/2027 (d)(f)		1 100	0,38	
0,625 % éch. 18/01/2033				5,875 % éch. 20/06/2031		1 000	0,30	7,416 % éch. 06/06/2033		600	0,17	
4,125 % éch. 24/09/2025				Annington Funding PLC		2 000	0,42	NatWest Markets PLC		1 300	0,38	
4,550 % éch. 17/04/2026				2,308 % éch. 06/10/2032				6,375 % éch. 08/11/2027			0,53	
7,375 % éch. 07/09/2033				3,184 % éch. 12/07/2029		200	0,05	Network Rail Infrastructure Finance PLC		1 800	0,53	
Total Suisse		4 616	1,38	3,935 % éch. 12/07/2047		900	0,18	4,750 % éch. 29/11/2035		1 800	0,53	
				Assura Financing PLC		1 000	0,20	NIE Finance PLC		1 100	0,32	
				1,625 % éch. 30/06/2033				5,875 % éch. 01/12/2032			0,32	
				Aviva PLC		200	0,05	Northern Gas Networks Finance PLC		250	0,07	
				5,125 % éch. 04/06/2050				4,875 % éch. 15/11/2035		250	0,07	
				6,875 % éch. 20/05/2058		900	0,30	5,625 % éch. 23/03/2040		50	0,01	
				Barclays PLC		800	0,21	Northern Powergrid Yorkshire PLC		300	0,08	
				1,700 % éch. 03/11/2026				4,375 % éch. 05/07/2032		200	0,06	
				3,250 % éch. 12/02/2027		200	0,05	5,125 % éch. 04/05/2035				
				3,250 % éch. 17/01/2033		1 700	0,38	Northumbrian Water Finance PLC		1 000	0,27	
				6,369 % éch. 31/01/2031		1 800	0,52	4,500 % éch. 14/02/2031		883	0,25	
				8,407 % éch. 14/11/2032		600	0,18	5,625 % éch. 29/04/2033				
				Berkeley Group PLC		1 200	0,23	Notting Hill Genesis		700	0,14	
				2,500 % éch. 11/08/2031				2,000 % éch. 03/06/2036		1 000	0,20	
				Beyond Housing Ltd.		500	0,08	3,250 % éch. 12/10/2048		300	0,08	
				2,125 % éch. 17/05/2051				3,750 % éch. 20/12/2032				
				BG Energy Capital PLC		300	0,08	Pacific Quay Finance PLC		154	0,04	
				5,000 % éch. 04/11/2036				5,565 % éch. 25/07/2034				
				Blend Funding PLC		800	0,18	Paragon Treasury PLC		500	0,10	
				3,459 % éch. 21/09/2049				2,000 % éch. 07/05/2036				
				BP Capital Markets PLC		1 200	0,35	Peabody Capital PLC		900	0,18	
				5,773 % éch. 25/05/2038				3,250 % éch. 14/09/2048				
				BPHA Finance PLC		300	0,08	Places for People Homes Ltd.		900	0,23	
				4,816 % éch. 11/04/2044				3,625 % éch. 22/11/2028		786	0,23	
				British Land Co. PLC		2 100	0,48	5,875 % éch. 23/05/2031		568	0,17	
				2,375 % éch. 14/09/2029				Places for People Treasury PLC		800	0,16	
				British Telecommunications PLC		800	0,19	2,500 % éch. 26/01/2036				
				3,125 % éch. 21/11/2031		400	0,08	Platform HG Financing PLC		1 100	0,20	
				3,625 % éch. 21/11/2047		400	0,08	1,926 % éch. 15/09/2041				
				5,750 % éch. 13/02/2041		600	0,17	Prudential Funding Asia PLC		580	0,17	
				Cadent Finance PLC		950	0,18	6,125 % éch. 19/12/2031				
				2,625 % éch. 22/09/2038				Quadrag Finance PLC		800	0,19	
				2,750 % éch. 22/09/2046		700	0,12	3,375 % éch. 17/09/2029				
				5,750 % éch. 14/03/2034		500	0,14	RHP Finance PLC		350	0,07	
				Chanel Ceres PLC		€	600	0,14	3,250 % éch. 05/02/2048		251	0,07
				0,500 % éch. 31/07/2026				Riverside Finance PLC		900	0,21	
				Clarion Funding PLC		€	1 000	0,20	3,875 % éch. 05/12/2044			
				1,875 % éch. 22/01/2035				Sage Group PLC		800	0,18	
				1,875 % éch. 07/09/2051		1 400	0,20	1,625 % éch. 25/02/2031		1 500	0,34	
				3,125 % éch. 19/04/2048				2,875 % éch. 08/02/2034				
				Compass Group PLC		1 100	0,10	Santander UK Group Holdings PLC		1 400	0,34	
				4,375 % éch. 08/09/2032				2,421 % éch. 17/01/2029		600	0,16	
				Derwent London PLC		1 900	0,39	3,625 % éch. 14/01/2026		1 400	0,34	
				1,875 % éch. 17/11/2031				7,098 % éch. 16/11/2027		500	0,15	
				Diageo Finance PLC		600	0,13	Scotland Gas Networks PLC		300	0,08	
				2,750 % éch. 08/06/2038				4,875 % éch. 21/12/2034				
				EMH Treasury PLC		300	0,08	Scottish Hydro Electric Transmission PLC		1 050	0,21	
				4,500 % éch. 29/01/2044				2,125 % éch. 24/03/2036		2 350	0,49	
				ENW Finance PLC		400	0,09	Segro PLC		300	0,09	
				1,415 % éch. 30/07/2030				5,750 % éch. 20/06/2035				
				4,893 % éch. 24/11/2032		1 700	0,47	Severn Trent Utilities Finance PLC		600	0,10	
								2,000 % éch. 02/06/2040				
								2,625 % éch. 22/02/2033		1 000	0,23	
								4,625 % éch. 30/11/2034		400	0,11	
								4,875 % éch. 24/01/2042		800	0,21	
								5,250 % éch. 04/04/2036		300	0,08	
								Sky Ltd.		500	0,14	
								4,000 % éch. 26/11/2029				
								Society of Lloyd's		500	0,13	
								4,875 % éch. 07/02/2047				
								South Eastern Power Networks PLC		3 800	0,77	
								1,750 % éch. 30/09/2034				
								Southern Electric Power Distribution PLC		800	0,23	
								5,500 % éch. 07/06/2032				
								Southern Gas Networks PLC		1 600	0,34	
								3,100 % éch. 15/09/2036				

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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				FONDS D'INVESTISSEMENT			
4,500 % éch. 01/07/2053	\$ 1 180	£ 892	0,27	BONS DU TRÉSOR BRITANNIQUE				FONDS NEGOCIÉS EN BOURSE			
5,000 % éch. 01/07/2053	1 180	909	0,27	4,480 % éch. 03/07/2023 (b)(c)	£ 5 400	£ 5 401	1,61	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO			
5,500 % éch. 01/08/2053	1 180	924	0,28	4,510 % éch. 03/07/2023 (b)(c)	2 900	2 900	0,87	Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	2 500	£ 208	0,06
6,000 % éch. 01/08/2053	1 180	936	0,28	4,700 % éch. 17/07/2023 (b)(c)	5 400	5 390	1,61				
6,500 % éch. 01/07/2053	1 180	948	0,28	Total des Instruments à court terme		13 690	4,09	Total des Fonds d'investissement		£ 208	0,06
		4 615	1,38	Total des Valeurs mobilières		£ 345 991	103,33				
Total États-Unis	45 237		13,51								

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
BRC	4,940 %	30/06/2023	03/07/2023	£ 13 000	Bon du Trésor britannique 0,625 % échéance 31/07/2035	£ (13 263)	£ 13 000	£ 13 005	3,88
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	\$ 130	Billets du Trésor américain 4,625 % échéance 30/06/2025	(104)	102	102	0,03
Total des Contrats de mise en pension						£ (13 367)	£ 13 102	£ 13 107	3,91

⁽¹⁾ Comprend les intérêts courus.

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

* Un soldé 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 septembre	Court	09/2023	21	£ 27	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	30	33	0,01
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Long	09/2023	26	(20)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	5	(14)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Long	09/2023	35	(23)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	123	(183)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	2	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	33	(51)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Court	09/2023	194	88	0,03
				£ (142)	(0,04)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				£ (142)	(0,04)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

* Un soldé 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
Marks & Spencer PLC	1,000 %	20/06/2030	€ 500	£ 3	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	0,500 %	21/09/2024	£ 44 600	£ (904)	(0,27)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,728	16/12/2025	20 400	(737)	(0,22)
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,250	20/09/2053	5 300	228	0,07
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	4 000	92	0,03
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	800	6	0,00
À payer ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	6 800	(210)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/12/2026	\$ 3 100	(307)	(0,09)
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	17/06/2030	9 200	1 262	0,38
À recevoir ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	18/12/2029	9 300	856	0,25
À payer ⁽³⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	12/02/2045	2 100	(409)	(0,12)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/09/2023	9 200	78	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/09/2023	9 300	74	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	12/08/2023	2 100	(7)	0,00

Tableau des investissements Fonds UK Corporate 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	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547 %	09/03/2033	€ 1 600	£ (26)	(0,01)
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	400	(1)	0,00
À payer ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2033	1 900	18	0,01
À recevoir ⁽³⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	5 400	(4)	0,00
					£ 9	0,01
Total des Instruments financiers dérivés compensés					£ 12	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.

⁽³⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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	
BRC	08/2023	€ 759	£ 655	£ 3	£ (1)	£ 2	0,00	
	08/2023	£ 528	€ 606	0	(7)	(7)	0,00	
	08/2023	\$ 336	£ 268	4	0	4	0,00	
CBK	08/2023	1 059	832	0	(1)	(1)	0,00	
	DUB	£ 700	\$ 870	0	(16)	(16)	(0,01)	
JPM	08/2023	€ 6 241	£ 5 437	72	0	72	0,02	
	08/2023	£ 1 695	€ 1 964	0	(6)	(6)	0,00	
	08/2023	\$ 3 744	£ 2 956	12	0	12	0,00	
MBC	08/2023	£ 1 304	€ 1 505	0	(10)	(10)	0,00	
	08/2023	461	\$ 587	1	0	1	0,00	
	08/2023	¥ 12 500	£ 74	6	0	6	0,00	
MYI	08/2023	£ 366	\$ 458	0	(6)	(6)	0,00	
RBC	08/2023	€ 63	£ 55	0	0	0	0,00	
	08/2023	£ 1 245	€ 1 427	0	(18)	(18)	(0,01)	
	08/2023	1 105	\$ 1 374	0	(23)	(23)	(0,01)	
SCX	08/2023	\$ 722	£ 571	4	0	4	0,00	
	08/2023	€ 9 873	8 621	131	0	131	0,04	
	08/2023	£ 884	€ 1 028	0	0	0	0,00	
UAG	08/2023	1 028	\$ 1 291	0	(13)	(13)	0,00	
	08/2023	\$ 1 212	£ 946	0	(7)	(7)	0,00	
	08/2023	4 198	3 322	20	0	20	0,01	
					£ 253	£ (108)	£ 145	0,04
Total des Instruments financiers dérivés hors cote					£ 145			0,04
Total des Investissements					£ 359 320			107,31
Autres actifs et passifs à court terme					£ (24 485)			(7,31)
Actifs nets					£ 334 835			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) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 24 771 £ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 3 217 £ (31 décembre 2022 : 7 199 £) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	£ 345 995	£ 0	£ 345 995
Fonds d'investissement	208	0	0	208
Contrats de mise en pension	0	13 102	0	13 102
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	114	(99)	0	15
Totaux	£ 322	£ 358 998	£ 0	£ 359 320

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 30 juin 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
SCX	4,340 %	16/05/2023	08/08/2023	£ (15 930)	£ (16 017)	(4,78)
	4,650	16/05/2023	08/08/2023	(8 984)	(9 037)	(2,70)
Total des Contrats de prise en pension					£ (25 054)	(7,48)

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	£ S/O	£ S/O	£ S/O	£ 260	£ (330)	£ (70)
BRC	(1)	0	(1)	S/O	S/O	S/O
CBK	(1)	0	(1)	S/O	S/O	S/O
DUB	(16)	0	(16)	S/O	S/O	S/O
GLM	S/O	S/O	S/O	(87)	0	(87)
JPM	78	0	78	S/O	S/O	S/O
MBC	(3)	0	(3)	(9)	0	(9)
MYI	(6)	0	(6)	(8)	0	(8)
RBC	(37)	0	(37)	S/O	S/O	S/O
SCX	111	0	111	S/O	S/O	S/O
SSB	S/O	S/O	S/O	(213)	0	(213)
UAG	20	0	20	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	99,95	94,43
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	3,38	1,35
Fonds d'investissement	0,06	1,38
Contrats de mise en pension	3,91	0,05
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,04)	0,16
Instruments financiers dérivés compensés	0,01	0,48
Instruments financiers dérivés hors cote	0,04	(0,02)
Contrats de prise en pension	(7,48)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	0,12	S/O
Autriche	S/O	0,05
Belgique	0,08	0,07
Canada	1,21	0,20
Îles Caïmans	0,13	0,12
République tchèque	0,02	S/O
Danemark	0,90	0,82
France	4,28	3,51
Allemagne	1,31	2,21
Irlande	1,51	1,24
Italie	0,24	0,57
Japon	S/O	0,31
Jersey, Îles Anglo-normandes	1,65	1,71
Luxembourg	0,68	1,18
Pays-Bas	5,53	5,67
Norvège	0,53	0,42
Singapour	0,22	0,20
Espagne	0,68	1,11
Supranationales	3,49	3,11
Suède	0,65	0,44
Suisse	1,38	0,89
Royaume-Uni	61,12	59,89
États-Unis	13,51	11,68
Instruments à court terme	4,09	0,38
Fonds d'investissement	0,06	1,38
Contrats de mise en pension	3,91	0,05
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,04)	0,16
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	(0,01)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,10
Swaps de taux d'intérêt	0,01	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	S/O	(0,03)
Contrats de change à terme	0,04	0,01
Autres actifs et passifs à court terme	(7,31)	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								SUPRANATIONALES			
AUSTRALIE								OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
BHP Billiton Finance Ltd. 4,300 % éch. 25/09/2042	£ 500	£ 420	0,14	Intesa Sanpaolo SpA 7,778 % éch. 20/06/2054	\$ 1 000	£ 784	0,26	Banque européenne d'investissement 3,875 % éch. 08/06/2037	£ 1 200	£ 1 104	0,37
ÎLES CAÏMANS				JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				SUEDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Southern Water Services Finance Ltd. 3,000 % éch. 28/05/2037	1 700	1 153	0,39	AA Bond Co. Ltd. 3,250 % éch. 31/07/2050	£ 200	152	0,05	Investor AB 5,500 % éch. 05/05/2037	1 300	1 307	0,44
4,500 % éch. 31/03/2052	700	573	0,19	5,500 % éch. 31/07/2050	180	157	0,05				
Total Îles Caïmans		1 726	0,58	CPUK Finance Ltd. 6,136 % éch. 28/02/2047	700	662	0,22				
DANEMARK				Gatwick Funding Ltd.				ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Orsted A/S 2,500 % éch. 16/05/2033	850	638	0,21	2,625 % éch. 07/10/2048	1 400	802	0,27	3i Group PLC 3,750 % éch. 05/06/2040	1 400	999	0,34
5,125 % éch. 13/09/2034	1 200	1 121	0,38	2,875 % éch. 05/07/2051	1 800	1 051	0,35	Accent Capital PLC 2,625 % éch. 18/07/2049	400	248	0,08
5,375 % éch. 13/09/2042	2 100	1 973	0,66	3,125 % éch. 28/09/2041	1 000	677	0,23	Anglian Water Services Financing PLC 6,000 % éch. 20/06/2039	400	400	0,13
Total Danemark		3 732	1,25	3,250 % éch. 26/02/2048	900	573	0,19	Annington Funding PLC 2,308 % éch. 06/10/2032	1 600	1 114	0,37
FRANCE				HSBC Bank Capital Funding Sterling LP				ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
AXA S.A. 5,453 % éch. 04/03/2026 (a)	600	584	0,19	5,750 % éch. 23/01/2039	129	121	0,04	Aviva PLC 4,000 % éch. 03/06/2055	1 600	1 199	0,40
BNP Paribas S.A. 2,000 % éch. 13/09/2036	1 600	1 004	0,34	Heathrow Funding Ltd. 2,750 % éch. 09/08/2051	2 000	1 167	0,39	Barclays PLC 3,250 % éch. 17/01/2033	1 530	1 147	0,39
4,625 % éch. 12/01/2027 (a)(b)	\$ 400	249	0,08	3,250 % éch. 26/02/2048	2 377	1 932	0,65	8,875 % éch. 15/09/2027 (a)(b)	500	461	0,15
5,750 % éch. 13/06/2032	£ 400	380	0,13	5,875 % éch. 13/05/2043	300	290	0,10	9,250 % éch. 15/09/2028 (a)(b)	900	815	0,27
Électricité de France S.A. 5,125 % éch. 22/09/2050	4 800	3 851	1,29	Total Jersey, îles Anglo-normandes	2 321	2 333	0,79	Berkeley Group PLC 2,500 % éch. 11/08/2031	800	523	0,18
5,500 % éch. 27/03/2037	3 600	3 157	1,06	Aroundtown S.A. 3,000 % éch. 16/10/2029	300	190	0,06	BG Energy Capital PLC 5,000 % éch. 04/11/2036	300	278	0,09
5,500 % éch. 17/10/2041	4 800	4 137	1,39	Becton Dickinson Euro Finance SARL 1,336 % éch. 13/08/2041	€ 900	494	0,17	Blend Funding PLC 3,459 % éch. 21/09/2049	300	220	0,07
5,625 % éch. 25/01/2053	1 900	1 628	0,55	Prologis International Funding S.A. 3,000 % éch. 22/02/2042	£ 1 000	669	0,23	BP Capital Markets PLC 5,773 % éch. 25/05/2038	100	99	0,03
Engie S.A. 5,000 % éch. 01/10/2060	700	617	0,21	Total Luxembourg		1 353	0,46	BPHA Finance PLC 4,816 % éch. 11/04/2044	495	447	0,15
Orange S.A. 5,625 % éch. 23/01/2034	1 575	1 577	0,53	MEXIQUE				British Land Co. PLC 2,375 % éch. 14/09/2029	800	611	0,21
Société Générale S.A. 6,250 % éch. 22/06/2033	500	497	0,17	OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,264 % éch. 24/09/2035	400	363	0,12
		17 681	5,94	America Movil S.A.B. de C.V. 4,375 % éch. 07/08/2041	388	322	0,11	British Telecommunications PLC 3,125 % éch. 21/11/2031	400	323	0,11
ÉMISSIONS SOUVERAINES				PAYS-BAS				ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
SNCF Réseau 5,000 % éch. 11/03/2052	400	389	0,13	Cooperative Rabobank UA 5,250 % éch. 23/05/2041	2 050	2 071	0,69	3,625 % éch. 21/11/2047	300	205	0,07
5,250 % éch. 31/01/2035	300	303	0,10	CTP NV 1,250 % éch. 21/06/2029	€ 400	249	0,08	5,750 % éch. 13/02/2041	2 500	2 312	0,78
		692	0,23	E.ON International Finance BV 4,750 % éch. 31/01/2034	£ 3 800	3 402	1,14	8,375 % éch. 20/12/2083	800	788	0,26
Total France		18 373	6,17	5,875 % éch. 30/10/2037	2 500	2 410	0,81	Broadgate Financing PLC 4,999 % éch. 05/10/2033	600	553	0,19
ALLEMAGNE				ENEL				ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Deutsche Telekom AG 3,125 % éch. 06/02/2034	1 700	1 372	0,46	6,125 % éch. 06/07/2039	1 650	1 628	0,55	5,098 % éch. 05/04/2035	88	77	0,03
IRLANDE				Enel Finance International NV				ROYAUME-UNI			
TITRES ADOSÉS À DES ACTIFS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Toro European CLO DAC 3,995 % éch. 12/01/2032	€ 2 600	2 188	0,73	5,750 % éch. 14/09/2040	2 763	2 606	0,87	Cadent Finance PLC 2,250 % éch. 10/10/2035	500	332	0,11
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Holcim Sterling Finance Netherlands BV				ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ESB Finance DAC 1,875 % éch. 21/07/2035	£ 300	202	0,07	2,250 % éch. 04/04/2034	1 800	1 243	0,42	2,625 % éch. 22/09/2038	2 700	1 742	0,58
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % éch. 18/01/2033	2 500	2 421	0,81	3,000 % éch. 12/05/2032	300	234	0,08	2,750 % éch. 22/09/2046	1 500	873	0,29
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co. 5,125 % éch. 23/11/2052	1 200	1 040	0,35	ING Groep NV 6,250 % éch. 20/05/2033	600	557	0,19	3,125 % éch. 21/03/2040	300	204	0,07
		3 663	1,23	JAB Holdings BV 2,250 % éch. 19/12/2039	€ 400	244	0,08	Catalyst Housing Ltd. 3,125 % éch. 31/10/2047	900	596	0,20
Total Irlande		5 851	1,96	Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,750 % éch. 10/09/2042	£ 2 200	1 841	0,62	Chancellor Masters & Scholars of the University of Cambridge 2,350 % éch. 27/06/2078	200	115	0,04
ITALIE				NORVÈGE				ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Enel SpA 5,750 % éch. 22/06/2037	2 000	1 908	0,64	Equinor ASA 4,250 % éch. 10/04/2041	700	610	0,21	3,750 % éch. 17/10/2052	800	667	0,22
SINGAPOUR				ROYAUME-UNI				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
				Temasek Financial Ltd.				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
				5,125 % éch. 26/07/2040				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
								Diageo Finance PLC			
								2,750 % éch. 08/06/2038			
								Eastern Power Networks PLC			
								2,125 % éch. 25/11/2033			
								721			
								519			
								0,17			

Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF NET	EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF NET	EN % DE L'ACTIF NET	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	VALEUR L'ACTIF NET	EN % DE L'ACTIF NET
EMH Treasury PLC 4,500 % éch. 29/01/2044	£ 800	£ 692	0,23	Meadowhall Finance PLC 4,988 % éch. 12/07/2037	£ 62	£ 47	0,02	Riverside Finance PLC 3,875 % éch. 05/12/2044	£ 600	£ 472	0,16
Eversholt Funding PLC 3,529 % éch. 07/08/2042	800	574	0,19	Metropolitan Housing Trust Ltd. 1,875 % éch. 28/07/2036	2 400	1 546	0,52	Sage Group PLC 1,625 % éch. 25/02/2031 2,875 % éch. 08/02/2034	1 000 1 700	735 1 281	0,25 0,43
Futures Treasury PLC 3,375 % éch. 08/02/2044	1 000	736	0,25	Mitchells & Butlers Finance PLC 5,965 % éch. 15/12/2025 6,002 % éch. 15/12/2030 6,013 % éch. 15/12/2030 6,876 % éch. 15/09/2034	37 660 523 993	36 478 470 813	0,01 0,16 0,16 0,27	Sanctuary Capital PLC 2,375 % éch. 14/04/2050 5,000 % éch. 26/04/2047	1 000 500	572 457	0,19 0,15
GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % éch. 12/05/2035 5,250 % éch. 19/12/2033 6,375 % éch. 09/03/2039	4 000 105 500	2 700 104 547	0,91 0,04 0,18	Morhomes PLC 3,400 % éch. 19/02/2040	4 200	3 185	1,07	Scottish Hydro Electric Transmission PLC 2,125 % éch. 24/03/2036 2,250 % éch. 27/09/2035	3 300 400	2 208 277	0,74 0,09
Grainger PLC 3,000 % éch. 03/07/2030 3,375 % éch. 24/04/2028	2 100 100	1 591 83	0,53 0,03	Notability Operations Group PLC 1,500 % éch. 20/01/2041 2,125 % éch. 18/01/2042 2,375 % éch. 03/07/2039 4,875 % éch. 17/01/2043	800 2 600 1 400 1 100	455 1 624 947 1 028	0,15 0,55 0,32 0,35	Segro PLC 5,750 % éch. 20/06/2035	300	294	0,10
Great Places Housing Group Ltd. 4,750 % éch. 22/10/2042	1 000	905	0,30	National Gas Transmission PLC 5,750 % éch. 05/04/2035	1 850	1 761	0,59	Severn Trent Utilities Finance PLC 2,000 % éch. 02/06/2040 2,625 % éch. 22/02/2033 4,625 % éch. 30/11/2034 4,875 % éch. 24/01/2042 5,250 % éch. 04/04/2036	1 800 556 300 1 300 300	1 050 421 267 1 140 280	0,35 0,14 0,09 0,38 0,09
Greene King Finance PLC 3,593 % éch. 15/03/2035 4,064 % éch. 15/03/2035 5,106 % éch. 15/03/2034 5,318 % éch. 15/09/2031	721 271 2 154 2 126	582 222 1 898 1 915	0,20 0,07 0,64 0,64	National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC 6,250 % éch. 10/12/2040	500	514	0,17	Society of Lloyd's 4,875 % éch. 07/02/2047	1 800	1 624	0,55
Guinness Partnership Ltd. 4,000 % éch. 24/10/2044	1 000	810	0,27	National Grid Electricity Distribution South Wales PLC 1,625 % éch. 07/10/2035	1 100	694	0,23	South Eastern Power Networks PLC 1,750 % éch. 30/09/2034	5 000	3 374	1,12
Haleon UK Capital PLC 3,375 % éch. 29/03/2038	1 920	1 456	0,49	National Grid Electricity Distribution South West PLC 5,750 % éch. 23/03/2040	700	682	0,23	Southern Electric Power Distribution PLC 4,625 % éch. 20/02/2037	1 500	1 312	0,44
Hexagon Housing Association Ltd. 3,625 % éch. 22/04/2048	1 300	888	0,30	National Grid Electricity Transmission PLC 2,000 % éch. 16/09/2038 2,000 % éch. 17/04/2040 2,750 % éch. 06/02/2035 5,272 % éch. 18/01/2043	1 200 2 008 600 2 000	732 1 178 438 1 834	0,25 0,40 0,15 0,62	Southern Gas Networks PLC 3,100 % éch. 15/09/2036 6,375 % éch. 15/05/2040	2 100 600	1 515 601	0,51 0,20
High Speed Rail Finance PLC 4,375 % éch. 01/11/2038	1 500	1 301	0,44	Nationwide Building Society 5,875 % éch. 20/12/2024 (a)(b)	700	655	0,22	Southern Housing 2,375 % éch. 08/10/2036 3,500 % éch. 19/10/2047	1 500 1 400	1 029 978	0,35 0,33
Home Group Ltd. 3,125 % éch. 27/03/2043	1 300	884	0,30	Nats En Route PLC 1,750 % éch. 30/09/2033	400	280	0,09	Sovereign Housing Capital PLC 2,375 % éch. 04/11/2048 5,705 % éch. 10/09/2039	200 700	117 710	0,04 0,24
HSBC Holdings PLC 5,875 % éch. 28/09/2026 (a)(b) 6,000 % éch. 29/03/2040	200 600	175 527	0,06 0,18	NatWest Group PLC 3,619 % éch. 29/03/2029 4,600 % éch. 28/06/2031 (a)(b)	2 000 600	1 719 328	0,58 0,11	Standard Chartered PLC 4,375 % éch. 18/01/2038 5,125 % éch. 06/06/2034	900 500	799 429	0,27 0,14
Hyde Housing Association Ltd. 1,750 % éch. 18/08/2055	1 600	739	0,25	Network Rail Infrastructure Finance PLC 4,750 % éch. 29/11/2035	400	397	0,13	Telereal Secured Finance PLC 4,010 % éch. 10/12/2033	1 234	1 088	0,37
Jigsaw Funding PLC 3,375 % éch. 05/05/2052	800	575	0,19	NIE Finance PLC 5,875 % éch. 01/12/2032	400	396	0,13	Telereal Securitisation PLC 6,165 % éch. 10/12/2033	85	81	0,03
John Lewis PLC 4,250 % éch. 18/12/2034	2 222	1 386	0,47	Northern Electric Finance PLC 2,750 % éch. 24/05/2049	2 150	1 365	0,46	Tesco Corporate Treasury Services PLC 5,500 % éch. 27/02/2035	1 800	1 664	0,56
Juturna European Loan Conduit PLC 5,064 % éch. 10/08/2033	967	916	0,31	Northern Gas Networks Finance PLC 4,875 % éch. 15/11/2035 5,625 % éch. 23/03/2040	900 800	796 746	0,27 0,25	Tesco Property Finance PLC 5,411 % éch. 13/07/2044 5,661 % éch. 13/10/2041 5,744 % éch. 13/04/2040 5,801 % éch. 13/10/2040 6,052 % éch. 13/10/2039	1 993 190 2 887 325 113	1 780 174 2 681 303 108	0,60 0,06 0,90 0,10 0,04
Karbon Homes Ltd. 3,375 % éch. 15/11/2047	300	220	0,07	Northern Powergrid Northeast PLC 1,875 % éch. 16/06/2062 3,250 % éch. 01/04/2052	100 600	47 413	0,02 0,14	Thames Water Utilities Finance PLC 2,375 % éch. 22/04/2040 2,625 % éch. 24/01/2032 4,375 % éch. 03/07/2034 4,625 % éch. 04/06/2046 5,125 % éch. 28/09/2037 5,500 % éch. 11/02/2041	1 100 300 3 700 700 800 200	632 221 2 987 528 668 172	0,21 0,07 1,00 0,18 0,22 0,06
Land Securities Capital Markets PLC 2,625 % éch. 22/09/2039 2,750 % éch. 22/09/2059	1 373 301	965 175	0,32 0,06	Northern Powergrid Yorkshire PLC 2,250 % éch. 09/10/2059 5,125 % éch. 04/05/2035	1 000 710	522 666	0,18 0,22	United Utilities Water Finance PLC 1,875 % éch. 03/06/2042 5,750 % éch. 26/06/2036	1 100 300 3 700	632 221 2 987	0,21 0,07 1,00
LCR Finance PLC 4,500 % éch. 07/12/2038	75	72	0,02	Northumbrian Water Finance PLC 4,500 % éch. 14/02/2031 5,625 % éch. 29/04/2033 6,375 % éch. 28/10/2034	800 400 1 020	717 383 1 025	0,24 0,13 0,34	University of Oxford 2,544 % éch. 08/12/2117	1 850	970	0,33
Legal & General Group PLC 4,500 % éch. 01/11/2050 5,500 % éch. 27/06/2064 5,625 % éch. 24/03/2031 (a)(b)	400 100 900	335 91 696	0,11 0,03 0,23	Notting Hill Genesis 2,000 % éch. 03/06/2036 3,250 % éch. 12/10/2048 5,250 % éch. 07/07/2042	2 534 1 141 199	1 660 761 185	0,56 0,26 0,06	Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % éch. 15/01/2030	1 100	868	0,29
Lendlease Europe Finance PLC 3,500 % éch. 02/12/2033	532	348	0,12	Orbit Capital PLC 3,375 % éch. 14/06/2048	700	483	0,16	Vodafone Group PLC 3,000 % éch. 12/08/2056 3,375 % éch. 08/08/2049	2 100 3 900	1 171 2 480	0,39 0,83
Liberty Living Finance PLC 3,375 % éch. 28/11/2029	600	487	0,16	Pacific Quay Finance PLC 5,565 % éch. 25/07/2034	768	743	0,25	Weir Group PLC 6,875 % éch. 14/06/2028	700	691	0,23
Lloyds Banking Group PLC 2,707 % éch. 03/12/2035 6,625 % éch. 02/06/2033	127 500	92 474	0,03 0,16	Paragon Treasury PLC 2,000 % éch. 07/05/2036	1 300	843	0,28	Wellcome Trust Finance PLC 4,625 % éch. 25/07/2036	500	481	0,16
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % éch. 31/03/2032 2,000 % éch. 20/10/2038 3,125 % éch. 28/02/2053 3,750 % éch. 27/10/2049 4,625 % éch. 05/12/2033	2 000 1 200 1 000 300 900	1 483 741 636 217 819	0,50 0,25 0,21 0,07 0,28	Peabody Capital PLC 3,250 % éch. 14/09/2048 5,250 % éch. 17/03/2043	2 400 300	1 615 281	0,54 0,09				
London Stock Exchange Group PLC 1,625 % éch. 06/04/2030	900	703	0,24	Places for People Treasury PLC 2,500 % éch. 26/01/2036	1 100	753	0,25				
Longstone Finance PLC 4,896 % éch. 19/04/2036	100	89	0,03	Platform HG Financing PLC 1,926 % éch. 15/09/2041	1 200	735	0,25				
M&G PLC 5,560 % éch. 20/07/2055	3 450	2 950	0,99	Prudential Funding Asia PLC 6,125 % éch. 19/12/2031	620	599	0,20				
Manchester Airport Group Funding PLC 2,875 % éch. 30/09/2044 4,750 % éch. 31/03/2034	2 050 500	1 303 454	0,44 0,15	RHP Finance PLC 3,250 % éch. 05/02/2048	700	503	0,17				
Marks & Spencer PLC 3,750 % éch. 19/05/2026	100	90	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
Wellcome Trust Ltd. 1,500 % éch. 14/07/2071	£ 5 600	£ 2 220	0,75	ÉMISSIONS SOUVERAINES				Mondelez International, Inc. 3,875 % éch. 06/03/2045	£ 100	£ 74	0,03
2,517 % éch. 07/02/2118	1 500	782	0,26	Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 31/07/2051	£ 21 600	£ 10 718	3,60	Morgan Stanley 5,789 % éch. 18/11/2033	800	768	0,26
4,000 % éch. 09/05/2059	400	348	0,12	1,500 % éch. 31/07/2053	400	209	0,07	National Fuel Gas Co. 2,950 % éch. 01/03/2031	\$ 159	100	0,03
Workspace Group PLC 2,250 % éch. 11/03/2028	450	330	0,11	1,750 % éch. 22/07/2057	3 800	2 109	0,71	Pfizer, Inc. 2,735 % éch. 15/06/2043	£ 4 600	£ 3 142	1,06
Yorkshire Housing Finance PLC 4,125 % éch. 31/10/2044	800	637	0,21	3,250 % éch. 22/01/2044 (c)	3 300	2 747	0,92	Realty Income Corp. 1,750 % éch. 13/07/2033	1 100	736	0,25
Yorkshire Water Finance PLC 1,750 % éch. 27/10/2032	715	499	0,17	3,750 % éch. 22/10/2053	2 800	2 490	0,83	2,500 % éch. 14/01/2042	500	302	0,10
2,750 % éch. 18/04/2041	1 100	705	0,24	Total Royaume-Uni		18 273	6,13	Time Warner Cable LLC 5,250 % éch. 15/07/2042	2 986	2 367	0,79
5,500 % éch. 28/04/2035	1 300	1 221	0,41			183 492	61,58	Verizon Communications, Inc. 1,875 % éch. 03/11/2038	2 700	1 603	0,54
		157 177	52,75	ÉTATS-UNIS				3,125 % éch. 02/11/2035	600	452	0,15
TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				2,800 % éch. 27/10/2036	2 800	2 132	0,72
Atlas Funding PLC 5,937 % éch. 20/01/2061	594	595	0,20	Apple, Inc. 3,600 % éch. 31/07/2042	1 400	1 164	0,39	4,750 % éch. 17/02/2034	1 000	905	0,30
Avon Finance PLC 5,809 % éch. 20/09/2048	719	718	0,24	AT&T, Inc. 4,250 % éch. 01/06/2043	5 113	3 913	1,31	Walmart, Inc. 5,250 % éch. 28/09/2035	2 000	2 006	0,67
Great Hall Mortgages PLC 3,697 % éch. 18/06/2038	€ 6	5	0,00	4,875 % éch. 01/06/2044	4 038	3 352	1,13	5,625 % éch. 27/03/2034	1 600	1 655	0,56
5,152 % éch. 18/03/2039	€ 6	6	0,00	Berkshire Hathaway Finance Corp. 2,375 % éch. 19/06/2039	400	272	0,09	Wells Fargo & Co. 2,125 % éch. 24/09/2031	400	296	0,10
Hops Hill PLC 5,854 % éch. 27/05/2054	394	394	0,13	2,625 % éch. 19/06/2059	100	59	0,02	4,625 % éch. 02/11/2035	1 729	1 529	0,51
Mansard Mortgages PLC 5,651 % éch. 15/12/2049	124	122	0,04	Charter Communications Operating LLC 5,125 % éch. 01/07/2049	\$ 500	310	0,10	4,875 % éch. 29/11/2035	1 700	1 442	0,48
Mortimer BTL PLC 5,614 % éch. 23/06/2053	1 006	995	0,34	Citigroup, Inc. 6,800 % éch. 25/06/2038	£ 2 000	2 213	0,74	Welltower OP LLC 4,500 % éch. 01/12/2034	1 000	821	0,28
5,976 % éch. 23/03/2054	775	775	0,26	Comcast Corp. 1,875 % éch. 20/02/2036	2 400	1 608	0,54			39 494	13,26
Newgate Funding PLC 4,126 % éch. 15/12/2050	€ 1 234	1 021	0,34	Credit Suisse AG ATI Claim ^	\$ 1 600	50	0,02	TITRES ADOSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
5,038 % éch. 01/12/2050	€ 60	57	0,02	Eli Lilly & Co. 1,625 % éch. 14/09/2043	£ 700	398	0,13	Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 5,650 % éch. 25/04/2035	\$ 144	100	0,03
Pierpont BTL PLC 0,000 % éch. 21/09/2054	900	898	0,30	Entergy Corp. 3,750 % éch. 15/06/2050	\$ 57	33	0,01	GSR Mortgage Loan Trust 4,662 % éch. 25/09/2035	0	0	0,00
Polaris PLC 5,631 % éch. 23/12/2058	534	531	0,18	Goldman Sachs Group, Inc. 3,625 % éch. 29/10/2029	£ 2 300	1 987	0,67	Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 5,633 % éch. 15/12/2030	3	3	0,00
Stratton Mortgage Funding PLC 5,391 % éch. 20/07/2060	651	651	0,22	6,875 % éch. 18/01/2038	500	499	0,17	Sequoia Mortgage Trust 3,565 % éch. 20/07/2037 ^	6	4	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,635 % éch. 20/10/2051	574	575	0,19	International Business Machines Corp. 4,875 % éch. 06/02/2038	200	179	0,06			107	0,03
Twin Bridges PLC 5,715 % éch. 12/03/2055	702	699	0,24	JPMorgan Chase & Co. 1,895 % éch. 28/04/2033	1 400	1 016	0,34	Total États-Unis		39 601	13,29
		8 042	2,70	McDonald's Corp. 2,950 % éch. 15/03/2034	400	314	0,11	Total des Valeurs mobilières	£	289 477	97,16
				3,750 % éch. 31/05/2038	2 100	1 679	0,56				

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 410	Billets du Trésor américain 4,625 % éch. 30/06/2025	£ (329)	£ 322	£ 322	0,11
SCX	4,900 %	30/06/2023	03/07/2023	£ 1 600	Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/10/2041	(1 644)	1 600	1 601	0,54
Total des Contrats de mise en pension						£ (1 973)	£ 1 922	£ 1 923	0,65

(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 Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	19	£ 21	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans septembre	Long	09/2023	2	6	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz septembre	Long	09/2023	46	(35)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans septembre	Court	09/2023	6	(18)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans septembre	Court	09/2023	12	27	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	29	(47)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Long	09/2023	24	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	14	6	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	20	(13)	0,00
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme septembre	Long	09/2023	5	(8)	0,00
				£ (60)	(0,02)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				£ (60)	(0,02)

Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate 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 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	3,250 %	20/09/2053	£ 11 900	£ (142)	(0,05)
À payer ⁽¹⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	20 900	(1 138)	(0,38)
À recevoir ⁽¹⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,750	20/09/2028	11 700	521	0,18
À payer ⁽¹⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	20/09/2025	3 400	(52)	(0,02)
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,000	16/12/2030	\$ 3 700	484	0,16
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/12/2050	100	27	0,01
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,500	18/12/2029	2 700	424	0,14
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,625	16/01/2050	100	34	0,01
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	21/06/2047	1 300	423	0,14
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,750	18/12/2049	400	136	0,05
À recevoir ⁽¹⁾	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	2,000	12/02/2045	6 600	2 161	0,73
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/09/2023	3 700	34	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/09/2023	100	1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/09/2023	3 500	28	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,625	16/07/2023	100	0	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	18/09/2023	400	3	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	21/09/2023	1 300	10	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	12/08/2023	6 600	21	0,01
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	20/09/2053	€ 500	(8)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,547	09/03/2033	1 400	(23)	(0,01)
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	20/09/2028	500	1	0,00
À recevoir ⁽¹⁾	EURIBOR EUR à 6 mois	3,500	20/09/2025	4 300	(3)	0,00
					£ 2 942	0,99
Total des Instruments financiers dérivés compensés					£ 2 942	0,99

⁽¹⁾ Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée.

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
BRC	08/2023	£ 710	€ 815	£ 0	£ (9)	£ (9)	0,00
	08/2023	362	\$ 448	0	(10)	(10)	0,00
	08/2023	\$ 733	£ 584	7	0	7	0,00
DUB	08/2023	£ 1 769	\$ 2 200	0	(39)	(39)	(0,01)
	JPM	08/2023	€ 4 896	£ 4 266	56	0	56
MBC	08/2023	\$ 8 166	£ 6 448	26	0	26	0,01
	08/2023	£ 3 435	€ 3 948	1	(42)	(41)	(0,01)
	08/2023	2 647	\$ 3 320	4	(40)	(36)	(0,01)
MYI	08/2023	¥ 27 000	£ 161	13	0	13	0,00
	08/2023	\$ 655	€ 511	0	(4)	(4)	0,00
	08/2023	£ 650	€ 753	0	(3)	(3)	0,00
RBC	08/2023	683	\$ 854	0	(11)	(11)	0,00
	08/2023	1 326	€ 1 526	1	(15)	(14)	(0,01)
	08/2023	2 966	\$ 3 677	0	(76)	(76)	(0,03)
SCX	08/2023	\$ 1 575	£ 1 246	8	0	8	0,00
	08/2023	£ 7 746	€ 6 764	104	0	104	0,03
	08/2023	£ 351	\$ 441	0	(4)	(4)	0,00
TOR	08/2023	1 275	€ 1 598	0	(18)	(18)	(0,01)
UAG	08/2023	522	€ 606	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	1 835	\$ 2 282	0	(40)	(40)	(0,01)
	08/2023	\$ 7 138	£ 5 648	34	0	34	0,01
				£ 254	£ (312)	£ (58)	(0,02)
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						£ (58)	(0,02)
Total des Investissements						£ 294 223	98,76
Autres actifs et passifs à court terme						£ 3 689	1,24
Actifs nets						£ 297 912	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) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(b) Titre convertible conditionnel.

(c) Un titre d'une juste valeur globale de 2 747 £ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 4 147 £ (31 décembre 2022 : 10 123 £) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	£ 289 477	£ 0	£ 289 477
Contrats de mise en pension		0	1 922	0	1 922
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾		(34)	2 858	0	2 824
Totaux	£	(34)	£ 294 257	£ 0	£ 294 223

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 30 juin 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
SCX	4,650 %	16/05/2023	08/08/2023	£ (2 898)	£ (2 915)	(0,98)
Total des Contrats de prise en pension					£ (2 915)	(0,98)

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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⁾	
	£	S/O	£	S/O	£	S/O	£	S/O	£	S/O	£	S/O
BOA												
BRC	(12)		0		(12)		1		0		1	
DUB	(39)		0		(39)		S/O		S/O		S/O	
GLM		S/O		S/O		S/O	(76)		0		(76)	
JPM	82		0		82		48		0		48	
MBC	(68)		0		(68)		9		0		9	
MYI	(14)		0		(14)		2		0		2	
RBC	(82)		0		(82)		S/O		S/O		S/O	
SCX	100		0		100		(4)		0		(4)	
SBB		S/O		S/O		S/O	(239)		0		(239)	
TOR	(18)		0		(18)		S/O		S/O		S/O	
UAG	(7)		0		(7)		(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	96,29	93,60
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	0,85	1,51
Autres valeurs mobilières	0,02	S/O
Contrats de mise en pension	0,65	0,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,02)	(0,54)
Instruments financiers dérivés compensés	0,99	1,83
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,02)	0,04
Contrats de prise en pension	(0,98)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	0,14	S/O
Belgique	S/O	0,19
Îles Caïmans	0,58	S/O
Danemark	1,25	1,23
France	6,17	5,11
Allemagne	0,46	2,80
Inde	S/O	0,05
Irlande	1,96	2,32
Italie	0,90	0,78
Japon	S/O	0,09
Jersey, Îles Anglo-normandes	3,33	2,73
Luxembourg	0,46	1,21
Mexique	0,14	0,13
Pays-Bas	5,53	5,45
Norvège	0,21	0,27
Singapour	0,35	0,33
Espagne	S/O	0,22
Supranationales	0,37	1,18
Suède	0,44	0,16
Suisse	S/O	1,21
Royaume-Uni	61,58	52,18
États-Unis	13,29	13,85
Instruments à court terme	S/O	3,62
Contrats de mise en pension	0,65	0,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,02)	(0,54)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	S/O	0,05
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,14
Swaps de taux d'intérêt	0,99	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	(0,02)	0,05
Autres actifs et passifs à court terme	1,24	3,48
Actifs nets	100,00	100,00

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	
4,250 % éch. 15/01/2034	\$ 3 000	\$ 2 270	0,12	DaVita, Inc.	\$ 7 000	\$ 5 606	0,28	Go Daddy Operating Co. LLC	\$ 5 000	\$ 4 289	0,22	
4,500 % éch. 15/08/2030	10 000	8 336	0,42	3,750 % éch. 15/02/2031	5 000	4 298	0,22	Golden Entertainment, Inc.	2 500	2 514	0,13	
4,500 % éch. 01/05/2032	10 000	7 994	0,40	4,625 % éch. 01/06/2030	1 245	1 136	0,06	7,625 % éch. 15/04/2026	6 700	5 729	0,29	
4,500 % éch. 01/06/2033	7 000	5 504	0,28	Dealer Tire LLC	1 000	784	0,04	Graham Packaging Co., Inc.	5 000	4 379	0,22	
4,750 % éch. 01/03/2030	5 000	4 280	0,22	8,000 % éch. 01/02/2028	8 000	8 075	0,41	Graphic Packaging International LLC	8 700	7 560	0,38	
5,000 % éch. 01/02/2028	2 000	1 824	0,09	Deluxe Corp.	115	111	0,01	Grifols Escrow Issuer S.A.	5 000	4 173	0,21	
5,375 % éch. 01/06/2029	4 000	3 620	0,18	4,625 % éch. 01/06/2029	31	30	0,00	4,750 % éch. 15/10/2028	2 500	991	0,05	
CDI Escrow Issuer, Inc.				Diamond BC BV	77	75	0,00	8,500 % éch. 01/06/2026	2 025	1 571	0,08	
5,750 % éch. 01/04/2030	2 000	1 863	0,09	4,625 % éch. 01/10/2029	8 000	275	0,01	Hertz Corp.	\$ 2 000	1 807	0,09	
Central Garden & Pet Co.				Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature)	2 500	2 443	0,12	5,000 % éch. 01/12/2029	1 000	828	0,04	
4,125 % éch. 15/10/2030	5 000	4 195	0,21	9,000 % éch. 22/04/2027 (b)(i)	5 000	4 020	0,20	Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5 000	4 173	0,21	
Charles River Laboratories International, Inc.				9,000 % éch. 22/04/2027 (b)	4 000	2 983	0,15	3,750 % éch. 01/05/2029	2 000	1 777	0,09	
3,750 % éch. 15/03/2029	2 000	1 762	0,09	Diamond Offshore Drilling, Inc.	5 000	4 379	0,22	4,000 % éch. 01/05/2031	1 000	869	0,04	
3,750 % éch. 15/03/2029	2 000	1 762	0,09	13,000 % éch. 21/12/2026	3 000	1 843	0,09	5,750 % éch. 01/05/2028	1 500	1 478	0,07	
4,000 % éch. 15/03/2031	1 000	870	0,04	Diamond Sports Group LLC	8 000	275	0,01	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC	3 000	2 520	0,13	
Cheplapharm Arzneimittel GmbH				5,375 % éch. 15/08/2026 ^	2 500	2 443	0,12	4,875 % éch. 01/07/2031	3 000	2 221	0,11	
5,500 % éch. 15/01/2028	500	453	0,02	Directv Financing LLC	10 000	9 068	0,46	5,000 % éch. 01/06/2029	2 500	2 221	0,11	
Chesapeake Energy Corp.				DISH DBS Corp.	5 000	4 020	0,20	6,750 % éch. 15/01/2027	3 000	2 860	0,14	
6,750 % éch. 15/04/2029	7 500	7 449	0,38	5,250 % éch. 01/12/2026	5 000	4 020	0,20	6,750 % éch. 15/07/2028 (a)	2 825	2 843	0,14	
Chobani LLC				5,750 % éch. 01/12/2028	4 000	2 983	0,15	8,875 % éch. 01/05/2028	1 000	869	0,04	
4,625 % éch. 15/11/2028	2 000	1 823	0,09	5,875 % éch. 15/11/2024	5 000	4 379	0,22	5,750 % éch. 01/05/2028	1 500	1 478	0,07	
Churchill Downs, Inc.				7,750 % éch. 01/07/2026	3 000	1 843	0,09	Hilton Midco SARR	€ 5 700	3 610	0,18	
4,750 % éch. 15/01/2028	5 000	4 643	0,24	DISH Network Corp.	2 500	2 443	0,12	5,250 % éch. 15/05/2029	5 700	3 610	0,18	
Clarios Global LP				11,750 % éch. 15/11/2027	2 500	2 443	0,12	Hertz Corp.	\$ 2 000	1 807	0,09	
4,375 % éch. 15/05/2026	€ 5 000	5 216	0,26	DT Midstream, Inc.	4 000	3 514	0,18	4,625 % éch. 01/12/2026	\$ 2 000	1 807	0,09	
6,250 % éch. 15/05/2026	\$ 1 750	1 741	0,09	4,125 % éch. 15/06/2029	4 000	3 514	0,18	5,000 % éch. 01/12/2029	1 000	828	0,04	
6,750 % éch. 15/05/2028	5 000	4 988	0,25	4,375 % éch. 15/06/2031	2 500	2 157	0,11	Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5 000	4 173	0,21	
Clarivate Science Holdings Corp.				Element Solutions, Inc.	3 000	2 620	0,13	3,750 % éch. 01/05/2029	2 000	1 777	0,09	
4,875 % éch. 01/07/2029	5 000	4 441	0,22	Emerald Debt Merger Sub LLC	3 800	3 772	0,19	4,000 % éch. 01/05/2031	1 000	869	0,04	
Clear Channel International BV				6,125 % éch. 15/12/2030	3 800	3 772	0,19	5,750 % éch. 01/05/2028	1 500	1 478	0,07	
6,625 % éch. 01/08/2025	2 000	1 993	0,10	Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8 500	1 984	0,10	5,750 % éch. 01/05/2028	1 500	1 478	0,07	
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.				Endo DAC	8 000	420	0,02	6,750 % éch. 01/05/2026	500	420	0,02	
5,125 % éch. 15/03/2027	3 000	2 728	0,14	6,000 % éch. 30/06/2028 ^	8 000	420	0,02	8,375 % éch. 01/05/2027	8 750	5 841	0,30	
7,750 % éch. 15/04/2028	5 000	3 931	0,20	Energizer Holdings, Inc.	1 100	982	0,05	IHO Verwaltungen GmbH (4,750 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature)	2 000	1 847	0,09	
Cloud Software Group, Inc.				4,750 % éch. 15/06/2028	1 100	982	0,05	4,750 % éch. 15/09/2026 (b)	2 000	1 847	0,09	
6,500 % éch. 31/03/2029	7 000	6 239	0,32	EnLink Midstream LLC	5 000	4 843	0,25	IHO Verwaltungen GmbH (6,000 % en numéraire ou 6,750 % de rémunération en nature)	2 000	1 883	0,10	
3,000 % éch. 30/09/2029	4 000	3 498	0,18	5,625 % éch. 15/01/2028	5 000	4 843	0,25	6,000 % éch. 15/07/2028 (a)	2 000	1 883	0,10	
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.				6,500 % éch. 01/09/2030	2 500	2 500	0,13	IHO Verwaltungen GmbH (6,375 % en numéraire ou 7,125 % de rémunération en nature)	1 750	1 625	0,08	
8,750 % éch. 15/04/2030	10 000	8 838	0,45	EnLink Midstream Partners LP	4 150 % éch. 01/06/2025	1 987	1 929	0,10	6,375 % éch. 15/05/2029 (b)	1 750	1 625	0,08
Coherent Corp.				EQM Midstream Partners LP	4 000 % éch. 01/08/2024	1 123	1 100	0,06	Imola Merger Corp.	5 000	4 354	0,22
5,000 % éch. 15/12/2029	4 000	3 615	0,18	4,500 % éch. 15/01/2029	7 700	6 876	0,35	4,750 % éch. 15/05/2029	5 000	4 354	0,22	
CommScope Technologies LLC				4,750 % éch. 15/01/2031	4 450	3 903	0,20	Ingevity Corp.	5 000	4 273	0,22	
5,000 % éch. 15/03/2027	2 000	1 395	0,07	6,000 % éch. 01/07/2025	735	728	0,04	3,875 % éch. 01/11/2028	5 000	4 273	0,22	
6,000 % éch. 15/06/2025	1 500	1 400	0,07	6,500 % éch. 01/07/2027	2 000	1 975	0,10	Innophos Holdings, Inc.	8 000	7 944	0,40	
CommScope, Inc.				6,500 % éch. 15/07/2048	3 800	3 442	0,17	9,375 % éch. 15/02/2028	8 000	7 944	0,40	
4,750 % éch. 01/09/2029	4 500	3 552	0,18	Fertitta Entertainment LLC	2 000	1 757	0,09	Intelligent Packaging Holdco Issuer LP (9,000 % en numéraire ou 9,750 % de rémunération en nature)	3 000	2 285	0,12	
6,000 % éch. 01/03/2026	2 500	2 333	0,12	4,625 % éch. 15/01/2029	7 000	5 964	0,30	9,000 % éch. 15/01/2026 (b)	3 000	2 285	0,12	
Community Health Systems, Inc.				6,750 % éch. 15/01/2030	3 000	2 545	0,13	Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.	4 000	3 404	0,17	
4,750 % éch. 15/02/2031	5 000	3 785	0,19	First Student Bidco, Inc.	4 000 % éch. 31/07/2029	3 000	2 545	0,13	6,000 % éch. 15/09/2028	4 000	3 404	0,17
5,250 % éch. 15/05/2030	3 000	2 366	0,12	Ford Motor Co.	3 250 % éch. 12/02/2032	4 000	3 150	0,16	IntelSat Jackson Holdings S.A.	11 249	10 269	0,52
5,625 % éch. 15/03/2027	5 000	4 411	0,22	6,100 % éch. 19/08/2032	2 500	2 425	0,12	6,500 % éch. 15/03/2030	11 249	10 269	0,52	
6,125 % éch. 01/04/2030	1 500	895	0,05	Fortrea Holdings, Inc.	2 500	2 563	0,13	IQVIA, Inc.	5 000	4 832	0,24	
6,875 % éch. 15/04/2029	3 750	2 346	0,12	7,500 % éch. 01/07/2030	2 500	2 563	0,13	5,000 % éch. 15/10/2026	5 000	4 832	0,24	
Comstock Resources, Inc.				Foundation Building Materials, Inc.	11 000	9 199	0,47	Iris Holdings, Inc. (8,750 % en numéraire ou 9,500 % de rémunération en nature)	3 750	3 573	0,18	
5,875 % éch. 15/01/2030	2 000	1 739	0,09	6,000 % éch. 01/03/2029	11 000	9 199	0,47	8,750 % éch. 15/02/2026 (b)	3 750	3 573	0,18	
6,750 % éch. 01/03/2029	4 000	3 664	0,19	Frontier Communications Holdings LLC	5 000 % éch. 01/05/2028	2 000	1 728	0,09	Jeld-Wen, Inc.	1 500	1 455	0,07
Connect Finco SARR				5,000 % éch. 01/05/2028	2 000	1 837	0,09	4,625 % éch. 15/12/2025	1 500	1 455	0,07	
6,750 % éch. 01/10/2026	3 000	2 917	0,15	5,875 % éch. 15/10/2027	2 000	1 837	0,09	4,875 % éch. 15/12/2027	1 000	887	0,05	
Consolidated Communications, Inc.				6,750 % éch. 01/05/2029	4 000	3 107	0,16	LABL, Inc.	2 125	1 937	0,10	
5,000 % éch. 01/10/2028	2 000	1 503	0,08	Gap, Inc.	3 000	2 123	0,11	5,875 % éch. 01/11/2028	2 125	1 937	0,10	
Coty, Inc.				3,875 % éch. 01/10/2031	1 000	686	0,03	6,750 % éch. 15/07/2026	2 000	1 969	0,10	
3,875 % éch. 15/04/2026	€ 3 000	3 181	0,16	Garda World Security Corp.	1 500	1 374	0,07	8,250 % éch. 01/11/2029	3 000	2 514	0,13	
5,000 % éch. 15/04/2026	\$ 2 000	1 919	0,10	4,625 % éch. 15/02/2027	5 000	4 102	0,21	10,500 % éch. 15/07/2027	3 250	3 124	0,16	
6,500 % éch. 15/04/2026	1 500	1 488	0,08	6,000 % éch. 01/06/2029	5 000	4 102	0,21	Lamb Weston Holdings, Inc.	2 000	1 789	0,09	
Covanta Holding Corp.				GFL Environmental, Inc.	5 000	4 455	0,23	4,125 % éch. 31/01/2030	2 000	1 917	0,10	
4,875 % éch. 01/12/2029	750	650	0,03	3,500 % éch. 01/09/2028	5 000	4 455	0,23	4,875 % éch. 15/05/2028	2 000	1 917	0,10	
5,000 % éch. 01/09/2030	1 000	850	0,04	4,000 % éch. 01/08/2028	5 000	4 477	0,23	LBM Acquisition LLC	1 275	1 057	0,05	
CQP Holdco LP				5,125 % éch. 15/12/2026	1 000	966	0,05	6,250 % éch. 15/01/2029	1 275	1 057	0,05	
5,500 % éch. 15/06/2031	3 500	3 127	0,16					Legacy LifePoint Health LLC	4 000	3 100	0,16	
Cross, Inc.								4,375 % éch. 15/02/2027	4 000	3 100	0,16	
4,250 % éch. 15/03/2029	2 000	1 703	0,09					Level 3 Financing, Inc.	5 000	3 017	0,15	
CSC Holdings LLC								3,750 % éch. 15/07/2029	5 000	3 017	0,15	
3,375 % éch. 15/02/2031	4 000	2 711	0,14									
4,125 % éch. 01/12/2030	2 500	1 751	0,09									
6,500 % éch. 01/02/2029	2 000	1 619	0,08									
Ctec GmbH												
5,250 % éch. 15/02/2030	€ 5 000	4 535	0,23									

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en 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
LifePoint Health, Inc. 5,375 % éch. 15/01/2029	\$ 5 000	\$ 2 958	0,15	Owens-Brockway Glass Container, Inc. 7,250 % éch. 15/05/2031	\$ 2 125	\$ 1 932	0,10	SM Energy Co. 6,500 % éch. 15/07/2028	\$ 1 500	\$ 1 441	0,07
Lindblad Expeditions LLC 6,750 % éch. 15/02/2027	1 900	1 812	0,09	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC 4,375 % éch. 15/10/2028	3 000	3 041	0,15	Southwestern Energy Co. 4,750 % éch. 01/02/2032	1 000	883	0,04
Madison IAQ LLC 4,125 % éch. 30/06/2028	3 000	2 644	0,13	Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 4,000 % éch. 15/10/2027	5 000	4 427	0,22	Spectrum Brands, Inc. 3,875 % éch. 15/03/2031	3 000	2 828	0,14
MajorDrive Holdings LLC 6,375 % éch. 01/06/2029	2 250	1 825	0,09	Performance Food Group, Inc. 4,250 % éch. 01/08/2029	3 000	2 674	0,14	Spirit AeroSystems, Inc. 4,600 % éch. 15/06/2028	3 000	2 740	0,14
Marriott Ownership Resorts, Inc. 4,500 % éch. 15/06/2029	7 800	6 202	0,31	PetSmart, Inc. 4,750 % éch. 15/02/2028	1 500	1 447	0,07	Spirit Loyalty Cayman Ltd. 8,000 % éch. 20/09/2025	2 000	2 000	0,10
Mattel, Inc. 3,375 % éch. 01/04/2026	3 250	2 808	0,14	Permian Resources Operating LLC 5,375 % éch. 15/01/2026	1 000	1 002	0,05	Standard Industries, Inc. 3,375 % éch. 15/01/2031	4 000	3 225	0,16
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 7,875 % éch. 15/08/2026	3 000	2 764	0,14	Post Holdings, Inc. 4,500 % éch. 15/09/2031	5 000	4 768	0,24	Station Casinos LLC 4,500 % éch. 15/02/2028	3 250	3 216	0,16
McAfee Corp. 7,375 % éch. 15/02/2030	2 000	1 762	0,09	Prime Security Services Borrower LLC 3,375 % éch. 31/08/2027	8 500	7 865	0,40	Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP 5,875 % éch. 15/05/2025	3 000	3 215	0,16
Medline Borrower LP 3,875 % éch. 01/04/2029	4 000	3 932	0,20	Presidio Holdings, Inc. 4,875 % éch. 01/02/2027	5 000	4 974	0,25	Summer BC Bidco LLC 5,500 % éch. 31/10/2026	3 000	3 025	0,15
Merlin Entertainments Ltd. 5,750 % éch. 15/06/2026	9 000	7 835	0,40	Real Hero Merger Sub, Inc. 6,250 % éch. 15/01/2028	1 779	1 521	0,08	Superior Plus LP 4,500 % éch. 15/03/2029	4 300	3 717	0,19
Michaels Cos., Inc. 5,250 % éch. 01/05/2028	4 000	3 697	0,19	Radiate Holdco LLC 4,500 % éch. 15/09/2026	5 000	4 387	0,22	Syneos Health, Inc. 3,625 % éch. 15/01/2029	4 300	3 719	0,19
Midwest Gaming Borrower LLC 4,875 % éch. 01/05/2029	7 000	6 090	0,31	Real Hero Merger Sub, Inc. 6,250 % éch. 15/01/2028	4 000	3 849	0,19	Team Health Holdings, Inc. 6,375 % éch. 01/02/2025	10 300	5 478	0,28
Monitchem HoldCo 3 S.A. 8,750 % éch. 01/05/2028	18 000	15 637	0,79	Ritchie Bros Holdings, Inc. 6,750 % éch. 15/03/2028	2 500	2 349	0,12	TEGNA, Inc. 4,625 % éch. 15/03/2028	1 000	886	0,05
Motion Bondco DAC 6,625 % éch. 15/11/2027	2 000	1 930	0,10	Rockcliff Energy LLC 5,500 % éch. 15/10/2029	3 750	3 575	0,18	TK Elevator US, Newco, Inc. 5,250 % éch. 15/07/2027	3 500	3 238	0,16
MPH Acquisition Holdings LLC 5,750 % éch. 01/11/2028 (j)	3 000	2 427	0,12	Rockies Express Pipeline LLC 4,800 % éch. 15/05/2030	2 000	2 053	0,10	TransDigm, Inc. 4,625 % éch. 15/01/2029	7 000	6 235	0,32
Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028	5 000	4 420	0,22	Roller Bearing Co. of America, Inc. 4,375 % éch. 15/10/2029	4 000	2 340	0,12	Transocean, Inc. 8,375 % éch. 01/02/2028	7 000	6 611	0,33
Nabors Industries, Inc. 7,375 % éch. 15/05/2027	€ 800	864	0,04	Rolls-Royce PLC 3,625 % éch. 14/10/2025	2 000	1 261	0,06	Transocean, Inc. 8,375 % éch. 01/02/2028	7 000	6 111	0,33
NCL Corp. Ltd. 3,625 % éch. 15/12/2024	€ 1 000	916	0,05	Royal Caribbean Cruises Ltd. 4,250 % éch. 01/07/2026	2 000	2 077	0,11	Travel + Leisure Co. 4,625 % éch. 01/03/2030	5 000	4 236	0,21
NESCO Holdings, Inc. 5,500 % éch. 15/04/2029	\$ 7 000	6 530	0,33	Sabre GBLB, Inc. 7,375 % éch. 01/09/2025	1 000	889	0,05	TriNet TPI Holdings, Inc. 12,750 % éch. 31/12/2028	9 750	10 123	0,51
Newell Brands, Inc. 5,875 % éch. 01/04/2036	\$ 2 000	1 905	0,10	Scientific Games Holdings LP 6,625 % éch. 01/03/2030	183	171	0,01	TriNet Group, Inc. 3,500 % éch. 01/03/2029	5 000	4 352	0,22
Newfold Digital Holdings Group, Inc. 6,000 % éch. 15/02/2029	5 000	4 816	0,24	SciH Salt Holdings, Inc. 4,875 % éch. 01/05/2028	7 000	6 166	0,31	Triton Water Holdings, Inc. 6,250 % éch. 01/04/2029	2 000	1 719	0,09
Noble Finance LLC 8,000 % éch. 15/04/2030	4 000	3 746	0,19	Seagate HDD Cayman 8,250 % éch. 15/12/2029	5 000	4 472	0,23	Triumph Group, Inc. 7,750 % éch. 15/08/2025	4 000	3 893	0,20
Nokia Oyj 6,625 % éch. 15/05/2039	2 500	2 377	0,12	Sensata Technologies BV 4,000 % éch. 15/04/2029	1 150	1 202	0,06	9,000 % éch. 15/03/2028	5 250	5 367	0,27
Novelis Corp. 3,250 % éch. 15/11/2026	3 000	2 719	0,14	Sensata Technologies, Inc. 3,750 % éch. 15/02/2031	1 750	2 068	0,10				
NuStar Logistics LP 5,750 % éch. 01/10/2025	7 000	5 768	0,29	Sigma Holdco BV 7,875 % éch. 15/05/2026	£ 1 750	2 068	0,10				
Olympus Water U.S. Holding Corp. 3,875 % éch. 01/10/2028	5 000	4 448	0,23	Simmons Foods, Inc. 4,625 % éch. 01/03/2029	\$ 5 000	4 594	0,23				
Organon & Co. 4,125 % éch. 30/04/2028	2 000	1 910	0,10	Sirius XM Radio, Inc. 3,875 % éch. 01/09/2031	3 250	2 657	0,13				

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	661 211	\$ 6 011	0,30
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	6 209 417	61 833	3,13
		67 844	3,43
Total des Fonds d'investissement		\$ 67 844	3,43

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	2,400 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 10 034	Billets du Trésor américain 4,625 % éch. 30/06/2025	\$ (10 235)	\$ 10 034	\$ 10 034	0,51
Total des Contrats de mise en pension						\$ (10 235)	\$ 10 034	\$ 10 034	0,51

⁽¹⁾ Comprend les intérêts courus.

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
Newell Brands, Inc.	1,000 %	20/06/2028	\$ 2 275	\$ 20	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-40 à 5 ans	5,000 %	20/06/2028	\$ 168 200	\$ 2 781	0,14

Total des Instruments financiers dérivés compensés

\$ 2 801 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.

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	Devises à livrer	Devises à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BPS	07/2023	\$ 42 372	€ 38 671	\$ 0	\$ (182)	\$ (182)	(0,01)
	08/2023	€ 38 671	\$ 42 431	184	0	184	0,01
CBK	08/2023	CAD 872	654	0	(5)	(5)	0,00
JPM	08/2023	1 433	1 072	0	(12)	(12)	0,00
MBC	07/2023	£ 3 451	4 272	0	(116)	(116)	(0,01)
MYI	07/2023	€ 70	77	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 560	€ 514	1	0	1	0,00
	07/2023	40	£ 32	0	0	0	0,00
SOG	07/2023	€ 38 671	\$ 41 600	0	(590)	(590)	(0,03)
TOR	07/2023	\$ 4 385	£ 3 451	2	0	2	0,00
	08/2023	£ 3 451	\$ 4 386	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 187	\$ (907)	\$ (720)	(0,04)

Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 1 865	\$ 2 038	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	07/2023	\$ 116 442	€ 108 348	1 765	0	1 765	0,09
BPS	07/2023	€ 108 799	\$ 119 208	509	(1)	508	0,03
	07/2023	\$ 116 330	€ 108 209	1 729	(2)	1 727	0,09
	08/2023	118 571	108 063	0	(512)	(512)	(0,03)
CBK	07/2023	€ 110 393	\$ 119 976	0	(463)	(463)	(0,02)
	08/2023	\$ 116 082	€ 106 621	401	0	401	0,02
JPM	07/2023	€ 108 288	\$ 118 240	97	0	97	0,00
	07/2023	\$ 5 288	€ 4 945	108	0	108	0,01
	08/2023	118 405	108 288	0	(101)	(101)	(0,01)
MBC	07/2023	€ 749	\$ 803	0	(15)	(15)	0,00
	07/2023	\$ 44	€ 41	1	0	1	0,00
SOG	07/2023	116 237	108 053	1 649	0	1 649	0,08
				\$ 6 262	\$ (1 094)	\$ 5 168	0,26

Au 30 juin 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	07/2023	£ 20	\$ 25	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 15	£ 12	0	0	0	0,00
BPS	07/2023	£ 26	\$ 32	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 19 820	£ 15 999	526	(7)	519	0,03
BRC	07/2023	307	248	8	0	8	0,00
CBK	07/2023	£ 52	\$ 66	0	0	0	0,00
JPM	07/2023	15 673	19 818	0	(109)	(109)	(0,01)
	08/2023	\$ 19 822	£ 15 673	109	0	109	0,01
MBC	07/2023	18 966	15 320	511	0	511	0,03
MYI	07/2023	18 858	15 173	432	0	432	0,02
TOR	07/2023	£ 15 694	\$ 19 942	0	(10)	(10)	0,00
	08/2023	\$ 19 947	£ 15 694	10	0	10	0,00
				\$ 1 596	\$ (127)	\$ 1 469	0,08

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 5 917 0,30

Total des Investissements

\$ 1 954 908 98,85

Autres actifs et passifs à court terme

\$ 22 693 1,15

Actifs nets

\$ 1 977 601 100,00

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 : 0,39 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste Valeur	En % de l'actif net
DB Investors, Inc.	18/02/2015	\$ 0	\$ 0	0,00
DB Investors, Inc. - Exp. 28/06/2069	18/02/2015	0	0	0,00
Diamond Foreign Asset Co, (9,000 % Cash or 9,000 % PIK) 9,000 % éch. 22/04/2027	12/05/2021	115	111	0,01
Intelsat Emergence S.A.	11/02/2014 - 02/03/2022	15 552	3 498	0,18
		\$ 15 667	\$ 3 609	0,19

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 11 276 \$ (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 30 juin 2023.

Des titres d'une juste valeur globale de 503 \$ (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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 17 435 \$ (31 décembre 2022 : 10 449 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 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 30 juin 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	\$ 370	\$ 1 862 780	\$ 5 162	\$ 1 868 312
Fonds d'investissement	67 844	0	0	67 844
Contrats de mise en pension	0	10 034	0	10 034
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	0	8 718	0	8 718
Totaux	\$ 68 214	\$ 1 881 532	\$ 5 162	\$ 1 954 908

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⁾	Titres 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 30 juin 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	(1,250) %	28/06/2023	07/07/2023	\$ (2 784)	\$ (2 784)	(0,14)
	(0,750) %	28/06/2023	07/07/2023	(355)	(355)	(0,02)
BRC	(1,900) %	05/05/2023	TBD ⁽¹⁾	(1 745)	(1 740)	(0,09)
MYI	2,500	17/05/2023	TBD ⁽¹⁾	€ (968)	(1 060)	(0,05)
RDR	4,000	05/05/2023	TBD ⁽¹⁾	\$ (3 525)	(3 547)	(0,18)
Total des Contrats de prise en pension					\$ (9 486)	(0,48)

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 1 768	\$ (1 368)	\$ 400	\$ 9	\$ 0	\$ 9
BPS	2 243	(1 870)	373	S/O	S/O	S/O
BRC	8	0	8	1	0	1
CBK	(67)	0	(67)	3 592	(3 540)	52
GLM	S/O	S/O	S/O	2	0	2
JPM	92	0	92	(258)	0	(258)
MBC	381	(360)	21	1 402	(1 320)	82
MYI	433	(405)	28	(4)	0	(4)
RBC	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)
SCX	S/O	S/O	S/O	3 187	(3 050)	137
SOG	1 059	(790)	269	S/O	S/O	S/O
TOR	S/O	S/O	S/O	11	(20)	(9)
UAG	S/O	S/O	S/O	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	38,68	39,23
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	55,72	56,03
Autres valeurs mobilières	0,07	0,24
Fonds d'investissement	3,43	1,97
Contrats de mise en pension	0,51	0,47
Instruments financiers dérivés compensés	0,14	0,16
Instruments financiers dérivés hors cote	0,30	0,40
Contrats de prise en pension	(0,48)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,65	0,70
Obligations et billets privés	80,34	79,60
Obligations du Trésor américain	10,41	11,62
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	0,04	0,04
Titres adossés à des actifs	0,00	0,00
Actions ordinaires	0,20	0,21
Droits	0,01	0,01
Bons de souscription	0,00	0,00
Titres privilégiés	0,06	0,07
Instruments à court terme	2,76	3,25
Fonds d'investissement	3,43	1,97
Contrats de mise en pension	0,51	0,47
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,14	0,16
Instruments financiers dérivés hors cote		
Contrats de change à terme	(0,04)	(0,05)
Contrats de change à terme couverts	0,34	0,45
Autres actifs et passifs à court terme	1,15	1,50
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											
Charter Communications Operating LLC 6,795 % - 6,834 % éch. 01/02/2027	\$ 88	\$ 88	0,02	Charles Schwab Corp. 5,643 % éch. 19/05/2029	\$ 800	\$ 800	0,18	2,357 % éch. 18/08/2031	\$ 1 600	\$ 1 278	0,29
Qatar National Bank QPSC 5,966 % éch. 10/10/2023	400	400	0,09	Citigroup, Inc. 2,976 % éch. 05/11/2030	1 600	1 388	0,31	4,292 % éch. 12/09/2026	1 000	962	0,22
		488	0,11	3,785 % éch. 17/03/2033 (h)	200	177	0,04	4,583 % éch. 19/06/2029	400	377	0,08
				4,075 % éch. 23/04/2029	400	377	0,08	5,402 % éch. 11/08/2033	900	880	0,20
				6,270 % éch. 17/11/2033 (h)	2 000	2 124	0,48	6,500 % éch. 15/09/2037	100	100	0,02
				Citizens Bank N.A. 5,284 % éch. 26/01/2026	500	464	0,10	6,800 % éch. 01/06/2038	220	222	0,05
				Commonwealth Bank of Australia 3,784 % éch. 14/03/2032 (g)	400	336	0,08	Hudson Pacific Properties LP 4,650 % éch. 01/04/2029	100	71	0,02
				Cooperative Rabobank UA 4,655 % éch. 22/08/2028	400	383	0,09	5,950 % éch. 15/02/2028	300	239	0,05
				Corebridge Financial, Inc. 3,850 % éch. 05/04/2029	900	811	0,18	Invitation Homes Operating Partnership LP 2,300 % éch. 15/11/2028	1 300	1 107	0,25
				Corporate Office Properties LP 2,250 % éch. 15/03/2026	300	266	0,06	JAB Holdings BV 2,200 % éch. 23/11/2030	1 600	1 260	0,28
				2,750 % éch. 15/04/2031	1 400	1 065	0,24	JPMorgan Chase & Co. 2,182 % éch. 01/06/2028	700	623	0,14
				Credit Suisse AG 7,500 % éch. 15/02/2028	700	744	0,17	2,545 % éch. 08/11/2032	900	738	0,17
				Crown Castle, Inc. 2,100 % éch. 01/04/2031	500	400	0,09	2,580 % éch. 22/04/2032	5 100	4 238	0,95
				3,100 % éch. 15/11/2029	900	785	0,18	3,509 % éch. 23/01/2029	1 105	1 022	0,23
				4,300 % éch. 15/02/2029	600	565	0,13	3,782 % éch. 01/02/2028	40	38	0,01
				CubeSmart LP 3,125 % éch. 01/09/2026	600	553	0,12	4,000 % éch. 01/04/2025 (e)	2 900	2 636	0,59
				Deutsche Bank AG 2,222 % éch. 18/09/2024	1 000	987	0,22	5,350 % éch. 01/06/2034	400	403	0,09
				EPR Properties 4,500 % éch. 01/06/2027	450	404	0,09	Kilroy Realty LP 3,050 % éch. 15/02/2030	1 800	1 410	0,32
				4,750 % éch. 15/12/2026	100	91	0,02	KKR Group Finance Co. LLC 3,625 % éch. 25/02/2050	1 100	758	0,17
				4,950 % éch. 15/04/2028	400	358	0,08	Lazard Group LLC 3,625 % éch. 01/03/2027	100	93	0,02
				Equitable Holdings, Inc. 5,594 % éch. 11/01/2033	200	196	0,04	4,500 % éch. 19/09/2028	200	190	0,04
				ERP Operating LP 3,250 % éch. 01/08/2027	100	92	0,02	Legg Mason, Inc. 5,625 % éch. 15/01/2044	200	197	0,04
				Extra Space Storage LP 2,350 % éch. 15/03/2032	400	313	0,07	Life Storage LP 3,875 % éch. 15/12/2027	800	744	0,17
				Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % éch. 29/03/2028	€ 200	197	0,04	Lloyds Bank PLC 0,000 % éch. 02/04/2032	200	125	0,03
				4,625 % éch. 29/04/2030	\$ 1 400	1 313	0,30	Mid-America Apartments LP 1,100 % éch. 15/09/2026	1 200	1 048	0,24
				4,850 % éch. 17/04/2028	300	289	0,06	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,309 % éch. 20/07/2032	2 000	1 593	0,36
				Federal Realty OP LP 3,500 % éch. 01/06/2030	400	349	0,08	5,133 % éch. 20/07/2033	900	883	0,20
				Fifth Third Bancorp 4,772 % éch. 28/07/2030	800	748	0,17	5,406 % éch. 19/04/2034	500	496	0,11
				Gaci First Investment Co. 5,125 % éch. 14/02/2053	600	541	0,12	5,441 % éch. 22/02/2034	300	299	0,07
				GAIF Bond Issuer Pty. Ltd. 3,400 % éch. 30/09/2026	500	464	0,10	Mizuho Financial Group, Inc. 3,153 % éch. 16/07/2030	1 873	1 618	0,36
				Global Atlantic Fin Co. 3,125 % éch. 15/06/2031	200	151	0,03	6,123 % éch. 08/09/2024	1 600	1 601	0,36
				4,400 % éch. 15/10/2029	800	675	0,15	Morgan Stanley 4,889 % éch. 20/07/2033	1 400	1 348	0,30
				GLP Capital LP 3,350 % éch. 01/09/2024	700	676	0,15	5,250 % éch. 21/04/2034	3 600	3 557	0,80
				4,000 % éch. 15/01/2031	300	260	0,06	Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc. 4,500 % éch. 20/06/2028	200	193	0,04
				5,750 % éch. 01/06/2028	700	685	0,15	Muthoot Finance Ltd. 4,400 % éch. 02/09/2023	426	423	0,09
				Goldman Sachs Group, Inc. 2,383 % éch. 21/07/2032	1 500	1 202	0,27	Nasdaq, Inc. 5,550 % éch. 15/02/2034	400	402	0,09
				2,615 % éch. 22/04/2032	1 000	820	0,18	NatWest Group PLC 4,892 % éch. 18/05/2029	1 700	1 619	0,36
				3,691 % éch. 05/06/2028	655	616	0,14	Neuberger Berman Group LLC 4,500 % éch. 15/03/2027	1 000	944	0,21
				Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % éch. 15/03/2028	1 100	998	0,22	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,750 % éch. 09/03/2028	1 900	1 563	0,35
				Great-West Lifeco Finance LP 4,581 % éch. 17/05/2048	300	256	0,06	Nomura Holdings, Inc. 2,679 % éch. 16/07/2030	1 300	1 065	0,24
				Hanover Insurance Group, Inc. 4,500 % éch. 15/04/2026	800	775	0,17	5,386 % éch. 06/07/2027	2 100	2 062	0,46
				Highwoods Realty LP 4,125 % éch. 15/03/2028	500	438	0,10	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053	DKK 9 261	1 011	0,23
				4,200 % éch. 15/04/2029	200	169	0,04	Omega Healthcare Investors, Inc. 4,750 % éch. 15/01/2028	\$ 1 200	1 097	0,25
				Host Hotels & Resorts LP 3,500 % éch. 15/09/2030	1 300	1 103	0,25	Owl Rock Capital Corp. 2,875 % éch. 11/06/2028	300	245	0,06
				4,000 % éch. 15/06/2025	1 233	1 186	0,27	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,800 % éch. 23/06/2030	300	265	0,06
				HSBC Capital Funding Dollar LP 10,176 % éch. 30/06/2030 (e)	400	496	0,11	Physicians Realty LP 4,300 % éch. 15/03/2027	300	283	0,06
				HSBC Holdings PLC 2,099 % éch. 04/06/2026	900	833	0,19	Sagax AB 2,250 % éch. 13/03/2025	€ 300	309	0,07
								Santander Holdings USA, Inc. 2,490 % éch. 06/01/2028	\$ 700	605	0,14
								4,400 % éch. 13/07/2027	400	376	0,08

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade 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
6,499 % éch. 09/03/2029	\$ 600	\$ 594	0,13	3,750 % éch. 15/06/2029	132	121	0,03	Continental Resources, Inc.			
Santander UK Group Holdings PLC				5,250 % éch. 01/10/2030	274	266	0,06	5,750 % éch. 15/01/2031	400	380	0,09
1,532 % éch. 21/08/2026	1 700	1 515	0,34	Alaska Airlines Pass-Through Trust				CVS Health Corp.			
SBA Tower Trust				4,800 % éch. 15/02/2029	\$ 643	\$ 619	0,14	4,125 % éch. 01/04/2040	900	759	0,17
1,884 % éch. 15/07/2050	1 000	899	0,20	Alcon Finance Corp.				5,125 % éch. 21/02/2030	\$ 1 500	\$ 1 491	0,34
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				2,600 % éch. 27/05/2030	500	427	0,10	CVS Pass-Through Trust			
5,125 % éch. 29/10/2022 ^	2 100	126	0,03	Alliegon U.S. Holding Co., Inc.				5,789 % éch. 10/01/2026	36	35	0,01
5,250 % éch. 23/05/2023				3,550 % éch. 01/10/2027	1 100	1 018	0,23	6,036 % éch. 10/12/2028	132	131	0,03
(g)	600	36	0,01	Amdocs Ltd.				DAE Funding LLC			
SBL Holdings, Inc.				2,538 % éch. 15/06/2030	1 600	1 337	0,30	1,625 % éch. 15/02/2024	700	675	0,15
5,125 % éch. 13/11/2026	1 000	884	0,20	American Airlines Pass-Through Trust				Dell International LLC			
SELP Finance SARL				3,200 % éch. 15/12/2029	627	563	0,13	6,020 % éch. 15/06/2026	1 050	1 068	0,24
3,750 % éch. 10/08/2027	€ 300	307	0,07	3,250 % éch. 15/04/2030	697	591	0,13	6,200 % éch. 15/07/2030	900	936	0,21
SMBC Aviation Capital Finance DAC				3,375 % éch. 01/11/2028	360	324	0,07	Delta Air Lines Pass-Through Trust			
3,550 % éch. 15/04/2024	\$ 1 100	1 077	0,24	3,500 % éch. 15/08/2033	419	342	0,08	2,000 % éch. 10/12/2029	903	795	0,18
Société Générale S.A.				3,575 % éch. 15/07/2029	138	128	0,03	Directv Financing LLC			
6,691 % éch. 10/01/2034	200	204	0,05	3,600 % éch. 15/04/2031	219	185	0,04	5,875 % éch. 15/08/2027	1 100	998	0,22
6,750 % éch. 06/04/2028				4,000 % éch. 15/01/2027	413	373	0,08	Eastern Gas Transmission & Storage, Inc.			
(e)(g)	400	325	0,07	Amgen, Inc.				3,900 % éch. 15/11/2049	2 300	1 701	0,38
7,375 % éch. 04/10/2023	300	292	0,07	Apple, Inc.				Ecopetrol S.A.			
(e)(g)				4,850 % éch. 10/05/2053	2 100	2 154	0,48	8,875 % éch. 13/01/2033	300	297	0,07
Spirit Realty LP				ArcelorMittal S.A.				eHi Car Services Ltd.			
3,200 % éch. 15/02/2031	100	82	0,02	6,800 % éch. 29/11/2032	1 000	1 027	0,23	7,000 % éch. 21/09/2026	700	421	0,09
4,000 % éch. 15/07/2029	200	176	0,04	Ashtead Capital, Inc.				Elevance Health, Inc.			
Standard Chartered PLC				4,000 % éch. 01/05/2028	400	371	0,08	4,750 % éch. 15/02/2033	1 800	1 749	0,39
3,265 % éch. 18/02/2036	200	158	0,04	AstraZeneca PLC				Energy Transfer LP			
6,296 % éch. 06/07/2034 (a)	250	251	0,06	1,668 % éch. 17/01/2029	500	483	0,11	4,400 % éch. 15/03/2027	1 400	1 339	0,30
6,301 % éch. 09/01/2029	1 000	1 006	0,23	Bacardi Ltd.				5,750 % éch. 15/02/2033	1 000	1 008	0,23
Stifel Financial Corp.				5,250 % éch. 15/01/2029	1 100	1 092	0,25	5,950 % éch. 01/10/2043	100	94	0,02
4,000 % éch. 15/05/2030	600	513	0,12	BAE Systems PLC				6,500 % éch. 01/02/2042	100	101	0,02
STORE Capital Corp.				3,400 % éch. 15/04/2030	200	181	0,04	EnLink Midstream LLC			
4,500 % éch. 15/03/2028	200	175	0,04	Baptist Healthcare System Obligated Group				6,500 % éch. 01/09/2030	700	700	0,16
Sumitomo Mitsui Finance Group, Inc.				3,540 % éch. 15/08/2050	300	222	0,05	Enterprise Products Operating LLC			
1,474 % éch. 08/07/2025	1 100	1 011	0,23	BAT International Finance PLC				5,700 % éch. 15/02/2042	300	305	0,07
3,202 % éch. 17/09/2029 (g)	700	612	0,14	Bayer U.S. Finance LLC				Equifax, Inc.			
5,710 % éch. 13/01/2030	1 100	1 114	0,25	4,250 % éch. 15/12/2025	1 100	1 062	0,24	5,100 % éch. 01/06/2028	500	493	0,11
Synchrony Financial				6,562 % éch. 15/12/2023	900	899	0,20	ERAC USA Finance LLC			
7,250 % éch. 02/02/2033	1 200	1 082	0,24	Berry Global, Inc.				3,300 % éch. 01/12/2026	1 000	930	0,21
Toyota Motor Credit Corp.				1,570 % éch. 15/01/2026	1 500	1 353	0,30	Expedia Group, Inc.			
4,625 % éch. 12/01/2028	900	893	0,20	Boardwalk Pipelines LP				5,000 % éch. 15/02/2026	1 300	1 282	0,29
TP ICAP Finance PLC				3,400 % éch. 15/02/2031	500	431	0,10	Ferguson Finance PLC			
5,250 % éch. 29/05/2026	£ 400	469	0,11	Boeing Co.				3,250 % éch. 02/06/2030	300	261	0,06
UBS Group AG				5,930 % éch. 01/05/2060	700	694	0,16	Flex Ltd.			
2,593 % éch. 11/09/2025	\$ 400	381	0,09	British Airways Pass-Through Trust				4,750 % éch. 15/06/2025	300	293	0,07
3,126 % éch. 13/08/2030	900	759	0,17	4,125 % éch. 20/03/2033	274	244	0,05	Glencore Funding LLC			
4,282 % éch. 09/01/2028	1 250	1 156	0,26	4,250 % éch. 15/05/2034	207	190	0,04	5,400 % éch. 08/05/2028	100	99	0,02
5,959 % éch. 12/01/2034	1 400	1 394	0,31	Broadcom, Inc.				Global Payments, Inc.			
6,537 % éch. 12/08/2033	2 750	2 819	0,63	3,469 % éch. 15/04/2034	569	467	0,11	2,900 % éch. 15/05/2030	600	509	0,11
UDR, Inc.				Burlington Northern Santa Fe LLC				Greene King Finance PLC			
3,100 % éch. 01/11/2034	300	239	0,05	5,200 % éch. 15/04/2054	100	102	0,02	5,318 % éch. 15/09/2031	£ 110	126	0,03
3,500 % éch. 15/01/2028	300	275	0,06	Caesars Entertainment, Inc.				Greensaif Pipelines Bidco SARL			
VICI Properties LP				7,000 % éch. 15/02/2030	400	402	0,09	6,129 % éch. 23/02/2038	\$ 300	307	0,07
3,875 % éch. 15/02/2029	300	264	0,06	Cameron LNG LLC				Haleon U.S. Capital LLC			
4,500 % éch. 15/01/2028	100	92	0,02	3,302 % éch. 15/01/2035	1 400	1 169	0,26	3,375 % éch. 24/03/2029	2 400	2 182	0,49
5,125 % éch. 15/05/2032	600	562	0,13	Canadian Pacific Railway Co.				HCA, Inc.			
5,750 % éch. 01/02/2027	100	98	0,02	3,125 % éch. 01/06/2026	300	281	0,06	3,500 % éch. 15/07/2051	700	485	0,11
Vonovia SE				CDW LLC				5,500 % éch. 01/06/2033	900	899	0,20
0,000 % éch. 01/12/2025 (c)	€ 1 200	1 155	0,26	3,569 % éch. 01/12/2031	700	592	0,13	Health & Happiness International Holdings Ltd.			
Wells Fargo & Co.				Centene Corp.				13,500 % éch. 26/06/2026	600	568	0,13
2,393 % éch. 02/06/2028	\$ 800	713	0,16	2,450 % éch. 15/07/2028	1 100	941	0,21	Howard Midstream Energy Partners LLC			
3,196 % éch. 17/06/2027	4 400	4 134	0,93	Charter Communications Operating LLC				8,875 % éch. 15/07/2028 (a)	200	201	0,05
4,897 % éch. 25/07/2033	2 100	2 015	0,45	4,200 % éch. 15/03/2028	1 300	1 219	0,27	Humana, Inc.			
Weyerhaeuser Co.				Cheniere Energy Partners LP				5,875 % éch. 01/03/2033	800	832	0,19
4,000 % éch. 15/04/2030	1 300	1 197	0,27	3,250 % éch. 31/01/2032	400	330	0,07	Hyundai Capital America			
4,750 % éch. 15/05/2026	600	590	0,13	4,000 % éch. 01/03/2031	2 100	1 851	0,42	2,000 % éch. 15/06/2028	1 600	1 346	0,30
7,375 % éch. 15/03/2032	343	383	0,09	5,950 % éch. 30/06/2033	600	603	0,14	Illumina, Inc.			
		144 901	32,58	Cloud Software Group, Inc.				5,750 % éch. 13/12/2027	900	905	0,20
				6,500 % éch. 31/03/2029	100	89	0,02	Imperial Brands Finance PLC			
INDUSTRIE				Comcast Corp.				3,875 % éch. 26/07/2029	1 500	1 323	0,30
AbbVie, Inc.				5,500 % éch. 15/05/2064	500	507	0,11	4,250 % éch. 21/07/2025	500	480	0,11
4,250 % éch. 21/11/2049	200	173	0,04	Continental Airlines Pass-Through Trust				Incitec Pivot Finance LLC			
Adani Transmission Step-One Ltd.				4,000 % éch. 29/04/2026	211	204	0,05	3,950 % éch. 03/08/2027	500	469	0,11
4,000 % éch. 03/08/2026	400	350	0,08				Infor, Inc.				
Adventist Health System								1,750 % éch. 15/07/2025	600	548	0,12
5,430 % éch. 01/03/2032	300	298	0,07				Intel Corp.				
Air Canada Pass-Through Trust								5,200 % éch. 10/02/2033	1 200	1 212	0,27
3,300 % éch. 15/07/2031	770	683	0,15				Jabil, Inc.				
								5,450 % éch. 01/02/2029	200	199	0,04
								JetBlue Pass-Through Trust			
								2,750 % éch. 15/11/2033	252	215	0,05

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	27	\$ (43)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl septembre	Long	09/2023	4	(7)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans septembre	Court	09/2023	9	12	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Long	09/2023	8	(7)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans septembre	Long	09/2023	386	506	0,11
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Long	09/2023	28	46	0,01
				\$ 507	0,11

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR 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 de vente - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	\$ 111,500	21/07/2023	10	\$ (4)	\$ (4)	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans CBOT août	115,500	21/07/2023	10	(4)	0	0,00
Option de vente - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	123,000	21/07/2023	3	(1)	0	0,00
Option d'achat - Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans CBOT août	131,000	21/07/2023	3	(2)	(1)	0,00
				\$ (11)	\$ (5)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé

\$ 502 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
Airbus Finance BV	1,000 %	20/12/2025	€ 200	\$ 0	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20/12/2026	\$ 500	(4)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2023	1 400	(14)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	1 100	5	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2026	900	(8)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20/12/2023	€ 1 500	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2025	\$ 200	5	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2026	500	7	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2027	2 900	183	0,04
BP Capital Markets PLC	1,000	20/12/2025	€ 700	(3)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2024	400	(2)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2025	200	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2027	300	4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/06/2028	1 100	3	0,00
Devon Energy Corp.	1,000	20/12/2026	\$ 800	9	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20/12/2026	900	1	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20/12/2024	1 600	(2)	0,00
Expedia Group, Inc.	1,000	20/12/2026	300	0	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2024	1 300	(79)	(0,02)
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	500	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	300	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	1 200	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	200	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20/12/2026	710	(57)	(0,01)
General Motors Co.	5,000	20/06/2028	890	19	0,01
Hess Corp.	1,000	20/12/2026	1 200	11	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20/12/2023	200	(4)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20/12/2024	1 400	(28)	(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	219	0,05
Southwest Airlines Co.	1,000	20/12/2026	\$ 550	7	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20/06/2028	€ 800	2	0,00
Tesco PLC	1,000	20/12/2024	1 000	(12)	0,00
Tesco PLC	1,000	20/12/2027	2 400	22	0,01
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	500	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2026	\$ 1 200	(19)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2026	1 800	(30)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2028	1 400	4	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20/06/2024	€ 200	(4)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20/06/2028	1 600	(25)	(0,01)
				\$ 229	0,05

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate 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 CDX.IG-40 à 5 ans	1,000 %	20/06/2028	\$ 100 700	\$ 712	0,16

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	\$ (114)	(0,02)
À recevoir ⁽³⁾	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	20/09/2033	600	49	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,300	20/03/2028	¥ 231 200	47	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	0,000	04/08/2023	\$ 25 000	345	0,08
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti en USD composé-OIS à 1 jour	1,270	04/11/2023	25 000	(86)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,000	04/08/2023	25 000	(343)	(0,08)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,195	25/04/2027	ZAR 22 300	52	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,300	28/04/2027	3 900	8	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	17/03/2053	€ 3 850	1 810	0,41
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	1 600	(71)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	3 300	(310)	(0,07)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	1 400	(131)	(0,03)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,000	19/09/2023	HUF 115 000	(25)	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,250	19/09/2023	352 100	(84)	(0,02)
					\$ 1 147	0,26
Total des Instruments financiers dérivés compensés					\$ 2 088	0,47

⁽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.

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	3,380 %	31/07/2023	500	\$ (2)	\$ (2)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,780	31/07/2023	500	(2)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	10/07/2023	300	(2)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,370	10/07/2023	300	(2)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,060	14/07/2023	200	(1)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,360	14/07/2023	200	(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	3,200	06/07/2023	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	3,650	06/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	03/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	03/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	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	3,660	26/07/2023	200	(1)	(1)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,350	27/07/2023	200	0	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	200	0	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	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	3,660	26/07/2023	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	27/07/2023	200	0	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	200	(1)	(1)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,260	26/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,660	26/07/2023	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	27/07/2023	200	0	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,850	27/07/2023	200	0	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	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	3,750	10/07/2023	200	(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	3,250	20/07/2023	500	(1)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/07/2023	500	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	06/07/2023	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	3,650	06/07/2023	200	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,300	10/07/2023	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	3,750	10/07/2023	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	3,270	24/07/2023	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	3,670	24/07/2023	200	(1)	(1)	0,00
						\$ (28)	\$ (16)	(0,01)	

OPTIONS SUR TITRES

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. 01/08/2053	\$ 95,875	07/08/2023	600	\$ (4)	\$ (3)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % éch. 01/08/2053	97,875	07/08/2023	600	(3)	(1)	0,00
					\$ (7)	\$ (4)	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)	\$ 4	\$ 0	0,00
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20/12/2024	400	5	(2)	3	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	2 800	(41)	77	36	0,01
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/12/2025	500	11	(5)	6	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20/12/2024	400	(2)	6	4	0,00
DUB	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	300	0	4	4	0,00
GLM	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	2 300	(26)	65	39	0,01
GST	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	200	(2)	4	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	300	0	4	4	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20/12/2024	400	(9)	6	(3)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	400	0	5	5	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2027	1 000	(62)	50	(12)	0,00
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20/06/2025	300	0	(2)	(2)	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	1	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2028	400	(10)	10	0	0,00
					\$ (140)	\$ 229	\$ 89	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
BPS	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000 %	20/12/2023	\$ 100	\$ 12	\$ (9)	\$ 3	0,00
CBK	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	100	10	(8)	2	0,00
GST	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	400	48	(38)	10	0,01
JPM	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	300	33	(26)	7	0,00
					\$ 103	\$ (81)	\$ 22	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	Devises à livrer	Devises à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/(moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	07/2023	AUD 449	\$ 298	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	07/2023	\$ 575	AUD 879	10	0	10	0,00
	08/2023	298	449	1	0	1	0,00
BOA	07/2023	DKK 1 999	\$ 289	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	¥ 5 700	41	2	0	2	0,00
	07/2023	MXN 12 767	728	0	(15)	(15)	0,00
	07/2023	\$ 1 172	AUD 1 806	31	0	31	0,01
	07/2023	533	DKK 3 625	0	(2)	(2)	0,00
	08/2023	DKK 3 619	\$ 533	2	0	2	0,00
	08/2023	\$ 182	ZAR 3 322	0	(7)	(7)	0,00
	09/2023	175	IDR 2 623 448	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07/2023	AUD 1 360	\$ 901	0	(4)	(4)	0,00
	07/2023	\$ 4 338	¥ 603 008	0	(166)	(166)	(0,04)
	08/2023	902	AUD 1 360	4	0	4	0,00
	08/2023	2 486	MXN 43 281	17	0	17	0,00
	08/2023	ZAR 17 426	\$ 937	18	0	18	0,01
	09/2023	\$ 164	IDR 2 458 019	0	0	0	0,00
	10/2023	ZAR 8 009	\$ 430	11	0	11	0,00
BRC	08/2023	\$ 993	COP 4 231 838	8	0	8	0,00
	08/2023	ZAR 20 839	\$ 1 127	29	0	29	0,01
	09/2023	IDR 7 880	1	0	0	0	0,00
	09/2023	\$ 216	PEN 792	1	0	1	0,00
BSH	07/2023	112	413	2	0	2	0,00
CBK	07/2023	€ 2 242	\$ 2 406	0	(40)	(40)	(0,01)
	07/2023	\$ 1 262	PEN 4 628	14	0	14	0,00

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade 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
	08/2023	PEN 8 086	\$ 2 070	\$ 0	\$ (153)	\$ (153)	(0,03)
	08/2023	\$ 1 615	CLP 1 338 260	47	0	47	0,01
	08/2023	292	NOK 3 051	0	(7)	(7)	0,00
	09/2023	ZAR 10 952	\$ 620	44	0	44	0,01
CLY	07/2023	DKK 5 874	\$ 848	0	(13)	(13)	0,00
	08/2023	\$ 330	NOK 3 460	0	(7)	(7)	0,00
GLM	07/2023	PEN 3 280	\$ 898	0	(6)	(6)	0,00
	07/2023	\$ 84	PEN 307	0	0	0	0,00
	08/2023	CLP 1 328 207	\$ 1 623	0	(27)	(27)	(0,01)
	08/2023	\$ 129	NOK 1 364	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	414	PEN 1 511	1	0	1	0,00
	08/2023	ZAR 4 906	\$ 264	6	0	6	0,00
	09/2023	\$ 653	PEN 2 398	5	0	5	0,00
JPM	07/2023	¥ 203 411	\$ 1 422	15	0	15	0,00
	07/2023	\$ 1 006	£ 796	6	0	6	0,00
	08/2023	£ 796	\$ 1 006	0	(6)	(6)	0,00
	08/2023	\$ 1 422	¥ 202 546	0	(15)	(15)	0,00
	08/2023	47	NOK 503	0	0	0	0,00
	09/2023	73	IDR 1 102 119	0	0	0	0,00
	09/2023	715	INR 58 889	1	0	1	0,00
	10/2023	432	MXN 7 579	2	0	2	0,00
MYI	07/2023	£ 826	\$ 1 028	0	(23)	(23)	(0,01)
	07/2023	IDR 691 578	\$ 46	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 474	DKK 3 233	0	0	0	0,00
	07/2023	307	£ 243	2	0	2	0,00
	07/2023	46	IDR 691 578	0	0	0	0,00
	08/2023	CLP 10 053	\$ 12	0	0	0	0,00
	08/2023	DKK 3 227	\$ 474	0	0	0	0,00
	09/2023	\$ 209	IDR 3 116 556	0	(2)	(2)	0,00
	09/2023	154	INR 12 720	0	0	0	0,00
SCX	07/2023	AUD 660	\$ 438	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	\$ 438	AUD 660	1	0	1	0,00
	09/2023	679	IDR 10 144 750	0	(5)	(5)	0,00
	09/2023	447	INR 36 830	0	0	0	0,00
	09/2023	350	PEN 1 290	4	0	4	0,00
SSB	09/2023	453	BRL 2 298	18	0	18	0,00
				\$ 302	\$ (506)	\$ (204)	(0,05)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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	07/2023	\$ 39 283	€ 36 552	\$ 596	\$ 0	\$ 596	0,13
BPS	07/2023	€ 33 544	\$ 36 754	157	0	157	0,04
	07/2023	\$ 39 146	€ 36 414	582	0	582	0,13
	08/2023	36 792	33 532	0	(159)	(159)	(0,04)
BRC	07/2023	€ 817	\$ 894	2	0	2	0,00
	07/2023	\$ 747	€ 697	13	0	13	0,00
CBK	07/2023	€ 36 100	\$ 39 220	0	(165)	(165)	(0,04)
	08/2023	\$ 36 801	€ 33 802	127	0	127	0,03
DUB	07/2023	€ 9 487	\$ 10 148	0	(204)	(204)	(0,04)
JPM	07/2023	33 820	36 928	30	0	30	0,01
	07/2023	\$ 36 212	€ 33 869	740	0	740	0,17
	08/2023	36 980	33 820	0	(31)	(31)	(0,01)
MYI	07/2023	€ 15	\$ 16	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 566	€ 516	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07/2023	6 139	5 736	120	0	120	0,03
				\$ 2 367	\$ (562)	\$ 1 805	0,41

Au 30 juin 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	07/2023	£ 45	\$ 58	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 248	£ 196	1	0	1	0,00
BPS	07/2023	£ 4	\$ 5	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 9 621	£ 7 771	261	(2)	259	0,06
BRC	07/2023	£ 38	\$ 49	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 392	£ 311	3	0	3	0,00
CBK	07/2023	£ 21	\$ 17	0	0	0	0,00
JPM	07/2023	£ 7 758	\$ 9 809	0	(54)	(54)	(0,01)
	07/2023	\$ 6	£ 5	0	0	0	0,00
	08/2023	9 761	7 718	54	0	54	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
MYI	07/2023	£ 116	\$ 148	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 9 282	£ 7 468	212	0	212	0,05
SCX	07/2023	£ 24	\$ 29	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	\$ 9 419	£ 7 561	194	0	194	0,04
				\$ 725	\$ (57)	\$ 668	0,15
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						\$ 2 360	0,53
Total des Investissements						\$ 458 459	103,07
Autres actifs et passifs à court terme						\$ (13 666)	(3,07)
Actifs nets						\$ 444 793	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) 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) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) 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	\$ 177	0,04
Citigroup, Inc.	6,270	17/11/2033	09/11/2022	2 000	2 124	0,48
Oracle Corp.	6,250	09/11/2032	07/11/2022	998	1 062	0,24
				\$ 3 198	\$ 3 363	0,76

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 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 11 254 \$ (31 décembre 2022 : 11 785 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 350 \$ (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. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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)	(Niveau 2)	(Niveau 3)			
Valeurs mobilières	\$ 696	\$ 383 449	\$ 562		\$ 384 707	
Fonds d'investissement	43 534	0	0		43 534	
Contrats de mise en pension	0	25 268	0		25 268	
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾	6	4 944	0		4 950	
Totaux	\$ 44 236	\$ 413 661	\$ 562		\$ 458 459	

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 2)	(Niveau 3)			
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 par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 10	\$ 0	\$ 10	\$ S/O	\$ S/O	\$ S/O
BOA	596	(570)	26	(108)	0	(108)
BPS	722	(670)	52	(856)	740	(116)
BRC	102	0	102	14	0	14
BSH	2	0	2	S/O	S/O	S/O
CBK	(131)	0	(131)	988	(750)	238
CLY	(20)	0	(20)	(36)	0	(36)
DUB	(200)	260	60	(1)	0	(1)
FBF	S/O	S/O	S/O	8	0	8
GLM	15	0	15	138	0	138
GST	16	0	16	23	0	23
JPM	748	(620)	128	240	(170)	70
MYC	(12)	90	78	(71)	90	19
MYI	186	(30)	156	(5)	(10)	(15)
RYL	S/O	S/O	S/O	294	0	294
SAL	(4)	0	(4)	(3)	0	(3)
SCX	312	(290)	22	979	(930)	49
SSB	18	0	18	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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	60,96	59,33
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	25,53	29,34
Autres valeurs mobilières	S/O	0,48
Fonds d'investissement	9,79	9,95
Contrats de mise en pension	5,68	3,96
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,11	0,18
Instruments financiers dérivés compensés	0,47	(0,37)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,53	0,42
Titres vendus à découvert	S/O	(0,52)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	S/O	(9,95)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,11	1,26
Obligations et billets privés	67,94	67,65
Obligations et billets municipaux	0,13	S/O
Agences du gouvernement américain	5,74	5,09
Obligations du Trésor américain	7,81	8,62
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	0,31	0,26
Titres adossés à des actifs	0,67	0,52
Émissions souveraines	1,20	2,12
Actions ordinaires	0,00	0,00
Bons de souscription	0,00	0,00
Titres privilégiés	0,16	0,17
Instruments à court terme	2,42	3,46
Fonds d'investissement	9,79	9,95
Contrats de mise en pension	5,68	3,96
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,11	0,18
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,05	(0,05)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,16	(0,03)
Swaps de taux d'intérêt	0,26	(0,29)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	S/O	0,54
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,01)	(0,96)
Options sur titres	0,00	(0,01)
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	0,01	0,01
Contrats de change à terme	(0,05)	(0,06)
Contrats de change à terme couverts	0,56	0,89
Titres vendus à découvert	S/O	(0,52)
Autres actifs et passifs à court terme	(3,07)	(2,77)
Actifs nets	100,00	100,00

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		
QATAR				Nationwide Building Society				Navigent Private Education Loan Trust					
CREDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				0,550 % éch. 22/01/2024				2,650 % éch. 15/12/2028					
Qatar National Bank QPSC				4,363 % éch. 01/08/2024				5,913 % éch. 15/12/2059					
5,966 % éch. 10/10/2023	\$ 900	\$ 900	0,04	NatWest Group PLC	5 000	4 913	0,24	6,643 % éch. 16/07/2040	2 579	2 575	0,12		
ARABIE SAOUDITE				4,269 % éch. 22/03/2025				6,793 % éch. 15/10/2031					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				NatWest Markets PLC				7,343 % éch. 15/12/2045					
Saudi Arabian Oil Co.				6,541 % éch. 22/03/2025				Navigent Student Loan Trust					
1,625 % éch. 24/11/2025	2 200	2 013	0,10	Santander UK Group Holdings PLC	8 900	8 942	0,43	6,893 % éch. 15/11/2030	3 681	3 644	0,18		
SINGAPOUR				4,796 % éch. 15/11/2024				7,700 % éch. 15/11/2030					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Standard Chartered PLC				Nelnet Student Loan Trust					
BOC Aviation Ltd.				6,021 % éch. 23/11/2025				5,750 % éch. 27/02/2051					
6,667 % éch. 26/09/2023	1 700	1 700	0,08	6,832 % éch. 30/03/2026	9 100	9 028	0,44	NovaStar Mortgage Funding Trust	7 700	7 721	0,37		
CORÉE DU SUD				12 000				5,810 % éch. 25/01/2036					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				101 369				4,91					
Korea Southern Power Co. Ltd.				Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux				RAAC Trust					
4,648 % éch. 30/10/2024	AUD 5 300	3 520	0,17	Avon Finance PLC	£ 9 822	12 484	0,60	7,250 % éch. 25/05/2044	1 336	1 289	0,06		
SK Hynix, Inc.				Canada Square Funding PLC				SBA Tower Trust					
1,000 % éch. 19/01/2024	\$ 12 804	12 447	0,60	5,682 % éch. 17/06/2058	5 605	7 087	0,34	3,869 % éch. 15/10/2049	3 000	2 909	0,14		
3,000 % éch. 17/09/2024	600	576	0,03	Eurohome UK Mortgages PLC	5,137 % éch. 15/06/2044	276	337	0,02	SLC Student Loan Trust	5,381 % éch. 15/05/2029	835	830	0,04
ÉMISSIONS SOUVERAINES				Great Hall Mortgages PLC				SLM Private Credit Student Loan Trust					
Banque de développement coréenne				5,172 % éch. 18/06/2038				5,842 % éch. 27/12/2038					
0,500 % éch. 27/10/2023	500	491	0,03	Lanebrook Mortgage Transaction PLC	3 490	4 443	0,21	5,882 % éch. 15/06/2039	6 175	5 858	0,28		
Total Corée du Sud				Precise Mortgage Funding PLC				5,882 % éch. 15/06/2039					
		17 034	0,83	5,657 % éch. 16/10/2056	1 606	2 039	0,10	SLM Student Loan Trust	5 722	5 499	0,27		
ESPAGNE				6,004 % éch. 12/03/2055				5,800 % éch. 27/12/2038					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Residential Mortgage Securities PLC				5,855 % éch. 25/10/2029					
Banco Santander S.A.				6,159 % éch. 20/06/2070				6,155 % éch. 25/07/2023					
3,892 % éch. 24/05/2024	7 900	7 748	0,38	Stratton Mortgage Funding PLC	5,391 % éch. 20/07/2060	15 067	19 158	0,93	6,955 % éch. 25/07/2023	163	163	0,01	
5,770 % éch. 30/06/2024	6 900	6 863	0,33	5,765 % éch. 12/03/2052	4 085	5 175	0,25	SMB Private Education Loan Trust	1 995	1 976	0,10		
Total Espagne				5,792 % éch. 25/09/2051				5,943 % éch. 15/11/2035					
		14 611	0,71	Towd Point Mortgage Funding PLC	5,472 % éch. 25/09/2051	5 472	6 941	0,34	6,643 % éch. 17/02/2032	1 699	1 679	0,08	
SUPRANATIONALES				Tudor Rose Mortgages				SoFi Professional Loan Program LLC					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,509 % éch. 20/06/2048				2,650 % éch. 25/09/2040					
Banque internationale pour la reconstruction et le développement				3 973				Structured Asset Investment Loan Trust					
0,650 % éch. 10/02/2026	10 000	9 021	0,44	Total Royaume-Uni	171 105	8,28	5,700 % éch. 25/09/2034						
SUISSE				Titres adossés à des actifs				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				6,875 % éch. 25/11/2035					
Credit Suisse AG				5,183 % éch. 25/03/2034				1 775					
5,464 % éch. 02/02/2024	2 000	1 985	0,10	CIT Mortgage Loan Trust	6,275 % éch. 25/03/2035	335	331	0,02	59 553	2,88			
UBS AG				College Avenue Student Loans LLC				OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
4,548 % éch. 30/07/2025	AUD 7 225	4 791	0,23	6,800 % éch. 26/11/2046	942	941	0,05	American Tower Corp.	9 000	8 814	0,43		
UBS Group AG				Commonbond Student Loan Trust				3,375 % éch. 15/05/2024					
6,669 % éch. 12/05/2026	\$ 15 000	15 078	0,73	2,730 % éch. 25/10/2040	384	352	0,02	4,000 % éch. 01/06/2025	3 300	3 189	0,15		
Total Suisse				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				Athene Global Funding					
		21 854	1,06	5,705 % éch. 25/06/2036	80	80	0,00	0,950 % éch. 08/01/2024	2 300	2 232	0,11		
ÉMIRATS ARABES UNIS				EFS Volunteer LLC				1,200 % éch. 13/10/2023					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				6,105 % éch. 25/10/2035				2,514 % éch. 08/03/2024					
First Abu Dhabi Bank PJSC				EquiFirst Mortgage Loan Trust				5,790 % éch. 24/05/2024					
5,019 % éch. 18/02/2025	AUD 1 040	690	0,03	8,150 % éch. 25/10/2034	582	545	0,03	5,941 % éch. 08/01/2024	1 300	1 265	0,06		
ROYAUME-UNI				Finance America Mortgage Loan Trust				Bank of America Corp.					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				5,975 % éch. 25/08/2034				0,976 % éch. 22/04/2025					
Barclays PLC				First NLC Trust				3,864 % éch. 23/07/2024					
1,007 % éch. 10/12/2024	\$ 3 000	2 925	0,14	5,220 % éch. 25/08/2037	230	118	0,01	6,422 % éch. 02/04/2026	12 500	11 988	0,58		
3,932 % éch. 07/05/2025	12 800	12 513	0,61	Fremont Home Loan Trust	5,885 % éch. 25/01/2035	247	238	0,01	5,351 % éch. 01/12/2023	2 118	2 115	0,10	
6,467 % éch. 26/06/2024	AUD 2 750	1 845	0,09	Home Equity Asset Trust	6,095 % éch. 25/06/2034	541	531	0,03	Baxter International, Inc.	4 400	4 439	0,21	
HSBC Bank PLC				Long Beach Mortgage Loan Trust				Bayer U.S. Finance LLC					
3,641 % éch. 28/09/2024	\$ 2 200	2 164	0,10	6,125 % éch. 25/04/2035	1 078	1 063	0,05	6,562 % éch. 15/12/2023	11 825	11 813	0,57		
HSBC Holdings PLC				MASTR Asset-Backed Securities Trust				Berry Global, Inc.					
6,770 % éch. 11/03/2025	15 500	15 564	0,75	5,850 % éch. 25/09/2034	838	710	0,03	4,875 % éch. 15/07/2026	7 450	7 168	0,35		
6,920 % éch. 12/09/2026	2 820	2 840	0,14	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust	6,200 % éch. 25/09/2033	609	600	0,03	BGC Partners, Inc.	5 044	5 041	0,24	
Imperial Brands Finance PLC				Mortgage Loan Trust				BOC Aviation USA Corp.					
3,125 % éch. 26/07/2024	13 600	13 145	0,64	6,125 % éch. 25/04/2035	1 078	1 063	0,05	1,625 % éch. 29/04/2024	300	290	0,01		
Lloyds Banking Group PLC				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				Brighthouse Financial Global Funding					
5,579 % éch. 07/03/2025	AUD 2 360	1 563	0,08	5,705 % éch. 25/06/2036	80	80	0,00	5,780 % éch. 12/04/2024	400	397	0,02		

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	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET	
BILLETS À COURT TERME				BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
Warnermedia Holdings, Inc. 3,428 % éch. 15/03/2024	\$ 12 325	\$ 12 104	0,59	5,175 % éch. 01/08/2023 (b)(c)(d)	\$ 209 000	\$ 208 149	10,07	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	6 321	\$ 63	0,00	
3,528 % éch. 15/03/2024	2 000	1 964	0,09	5,304 % éch. 29/08/2023 (b)(c)(d)	215 400	213 650	10,34					
		14 068	0,68	5,390 % éch. 31/10/2023 (b)(c)(d)	128 900	126 690	6,13					
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS						548 489	26,54	FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE				
(0,186) % éch. 07/08/2023 (c)(d)	¥ 2 486 000	17 202	0,83	Total des Instruments à court terme		619 380	29,97	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)				
(0,166) % éch. 07/08/2023 (c)(d)	424 000	2 934	0,14	Total des Valeurs mobilières		\$ 2 175 664	105,27	2 082 187		206 824	10,00	
		20 136	0,97					Total des Fonds d'investissement		\$ 206 887	10,00	

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	5,100 %	30/06/2023	03/07/2023	\$ 196 400	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/01/2029	\$ (200 759)	\$ 196 400	\$ 196 483	9,51	
	5,160	30/06/2023	03/07/2023	29 300	Billets du Trésor américain 0,500 % éch. 30/06/2027	(29 947)	29 300	29 313	1,42	
FICC	2,400	30/06/2023	03/07/2023	2 237	Billets du Trésor américain 4,625 % éch. 30/06/2025	(2 282)	2 237	2 237	0,11	
Total des Contrats de mise en pension							\$ (232 988)	\$ 227 937	\$ 228 033	11,04

⁽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 2 ans septembre	Court	09/2023	475	\$ 895	0,04
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans septembre	Court	09/2023	941	1 026	0,05
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans septembre	Court	09/2023	61	118	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans ultra septembre	Court	09/2023	79	107	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain ultra à long terme septembre	Court	09/2023	14	(28)	(0,01)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				\$ 2 118	0,10

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-40 à 5 ans	(1,000) %	20/06/2028	\$ 352 200	\$ (2 593)	(0,13)
Total des Instruments financiers dérivés compensés				\$ (2 593)	(0,13)

⁽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
BOA	07/2023	¥ 1 100	\$ 8	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 2 259	CAD 2 988	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	4 890	£ 3 867	26	0	26	0,00
	08/2023	AUD 88 451	\$ 59 791	843	0	843	0,04
	08/2023	\$ 3 285	AUD 5 017	58	0	58	0,00
	02/2024	CAD 1 000	\$ 747	0	(12)	(12)	0,00
BPS	07/2023	€ 85 239	91 633	0	(1 363)	(1 363)	(0,06)
	07/2023	\$ 93 258	€ 85 113	0	(400)	(400)	(0,02)
	08/2023	€ 85 113	\$ 93 389	404	0	404	0,02
BRC	09/2023	\$ 20	ILS 71	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07/2023	€ 8 437	\$ 9 054	0	(151)	(151)	(0,01)
	11/2023	ILS 9 434	\$ 2 738	179	0	179	0,01
DUB	02/2024	CAD 2 000	\$ 1 493	0	(23)	(23)	0,00
JPM	07/2023	\$ 9 156	€ 8 563	187	0	187	0,01
	07/2023	¥ 3	¥ 374	0	0	0	0,00
	08/2023	¥ 373	\$ 3	0	0	0	0,00
	09/2023	\$ 19	ILS 69	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07/2023	CAD 31	\$ 23	0	0	0	0,00
	07/2023	£ 60 641	75 065	0	(2 031)	(2 031)	(0,10)
MYI	07/2023	€ 386	\$ 421	0	0	0	0,00
	07/2023	\$ 1 114	£ 875	0	(2)	(2)	0,00
RBC	07/2023	MXN 60	\$ 3	0	0	0	0,00
	08/2023	\$ 18	MXN 319	0	0	0	0,00
TOR	07/2023	CAD 2 096	\$ 1 579	0	(5)	(5)	0,00
	07/2023	\$ 71 032	£ 55 899	36	0	36	0,00
	08/2023	£ 54 974	\$ 69 871	0	(35)	(35)	0,00
	08/2023	\$ 1 579	CAD 2 095	5	0	5	0,00
UAG	08/2023	¥ 2 910 000	\$ 21 468	1 234	0	1 234	0,05
	09/2023	\$ 17	ILS 59	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 2 972	\$ (4 026)	\$ (1 054)	(0,06)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 30 juin 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
BOA	07/2023	€ 25	\$ 27	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	07/2023	\$ 54 383	€ 50 602	824	0	824	0,04
BPS	07/2023	€ 45 378	\$ 49 721	213	0	213	0,01
	07/2023	\$ 504	€ 461	0	(1)	(1)	0,00
	08/2023	49 782	45 370	0	(216)	(216)	(0,01)
BRC	07/2023	€ 8 563	\$ 9 159	0	(183)	(183)	(0,01)
CBK	07/2023	\$ 51 552	€ 56 088	17	(173)	(156)	(0,01)
	07/2023	\$ 192	€ 179	3	0	3	0,00
	08/2023	49 640	45 594	171	0	171	0,01
GLM	07/2023	4 929	4 614	106	0	106	0,01
MBC	07/2023	€ 508	\$ 545	0	(9)	(9)	0,00
	07/2023	\$ 51 138	€ 47 842	1 058	0	1 058	0,05
SCX	07/2023	51 137	47 784	995	0	995	0,05
				\$ 3 387	\$ (582)	\$ 2 805	0,14

Au 30 juin 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
CBK	07/2023	\$ 83	£ 67	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
RBC	07/2023	83	67	2	0	2	0,00
SCX	07/2023	83	67	2	0	2	0,00
				\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote

\$ 1 756 0,08

Total des Investissements

\$ 2 611 769 126,36

Autres actifs et passifs à court terme

\$ (544 865) (26,36)

Actifs nets

\$ 2 066 904 100,00

Tableau des investissements Fonds US Short-Term 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) 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) 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	31/03/2023 - 31/05/2023	\$ 5 382	\$ 5 331	0,26

Un montant en numéraire de 11 983 \$ (31 décembre 2022 : 16 350 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 30 juin 2023.

Un montant en numéraire de 1 820 \$ (31 décembre 2022 : 1 780 \$) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) au 30 juin 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 30 juin 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	\$	2 174 512	\$	1 152	\$ 2 175 664
Fonds d'investissement		206 887		0		0	206 887
Contrats de mise en pension		0		227 937		0	227 937
Instruments financiers dérivés ⁽³⁾		0		1 281		0	1 281
Totaux	\$	206 887	\$	2 403 730	\$	1 152	\$ 2 611 769

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.

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Au 30 juin 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	\$ 1 566	\$ (1 460)	\$ 106
BOA	1 738	(1 790)	(52)	(2 159)	1 770	(389)
BPS	(1 363)	1 430	67	131	0	131
BRC	(184)	0	(184)	(17)	0	(17)
CBK	47	0	47	1 487	(1 350)	137
DUB	(23)	0	(23)	(4)	0	(4)
GLM	106	0	106	S/O	S/O	S/O
JPM	186	(260)	(74)	350	(290)	60
MBC	(982)	390	(592)	(153)	0	(153)
MYI	(2)	(10)	(12)	(2)	10	8
RBC	2	0	2	S/O	S/O	S/O
SCX	997	(1 050)	(53)	2 590	(2 250)	340
TOR	1	0	1	S/O	S/O	S/O
UAG	1 233	(1 100)	133	(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.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 30 juin 2023 :

	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	38,73	43,64
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	66,54	38,19
Autres valeurs mobilières	S/O	0,05
Fonds d'investissement	10,00	9,78
Contrats de mise en pension	11,04	6,69
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,10	0,04
Instruments financiers dérivés compensés	(0,13)	0,01
Instruments financiers dérivés hors cote	0,08	0,16

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 30 juin 2023 :

Investissements à la juste valeur	30 juin 2023 (%)	31 décembre 2022 (%)
Australie	1,56	1,66
Belgique	S/O	0,39
Bermudes	S/O	0,39
Îles Caïmans	6,87	3,83
Danemark	0,02	0,66
Finlande	0,13	0,38
France	2,03	2,56
Allemagne	1,00	1,17
Irlande	5,59	5,43
Israël	0,55	0,35
Italie	S/O	0,22
Japon	5,81	5,03
Luxembourg	S/O	0,10
Multinationales	0,12	S/O
Pays-Bas	2,50	3,03
Norvège	0,13	0,04
Qatar	0,04	S/O
Arabie saoudite	0,10	0,11
Singapour	0,08	0,07
Corée du Sud	0,83	0,84
Espagne	0,71	0,42
Supranationales	0,44	1,10
Suisse	1,06	1,42
Émirats arabes unis	0,03	0,08
Royaume-Uni	8,28	8,42
États-Unis	37,42	42,70
Instruments à court terme	29,97	1,48
Fonds d'investissement	10,00	9,78
Contrats de mise en pension	11,04	6,69
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,10	0,04
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,13)	0,01
Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base	S/O	0,00
Instruments financiers dérivés hors cote		
Contrats de change à terme	(0,06)	(0,11)
Contrats de change à terme couverts	0,14	0,27
Autres actifs et passifs à court terme	(26,36)	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 sur les sociétés de 2014 (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 (« Catégories »). Le Conseil d'administration (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 conseillers 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 Fonds spécifique, 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

Les principales méthodes comptables et techniques de valorisation adoptées par la Société et appliquées lors de la préparation des présents états financiers sont conformes à celles qui ont été appliquées aux états financiers annuels audités de la Société pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 (les « États financiers annuels audités »). Les états financiers sont établis selon le principe de la continuité d'exploitation pour l'ensemble des Fonds.

Base de préparation

Les états financiers présentés sont des états financiers condensés non audités établis pour la période de six mois close le 30 juin 2023. Ils sont préparés conformément à la norme FRS 104 (Financial Reporting Standard 104) : « Interim Financial Reporting » publiée par le Financial Reporting Council (« FRC ») et la Réglementation OPCVM.

Les états financiers condensés non audités doivent être lus conjointement aux États financiers annuels audités, sur lesquels le commissaire aux comptes a émis une opinion sans réserve et qui ont été préparés conformément aux principes comptables généralement acceptés en Irlande (FRS 102), aux lois irlandaises, notamment la Loi sur les sociétés de 2014, et la Réglementation OPCVM. Les normes comptables généralement admises en Irlande pour l'élaboration des états financiers sont celles émises par le FRC.

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 d'investissement à capital variable 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 a adopté le dollar américain comme devise de présentation. Les états financiers de chaque Fonds sont préparés dans la devise fonctionnelle de ce Fonds. Le Bilan de la Société est converti à l'aide des taux de change à la clôture de la période, 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 la période pour inclusion dans les états financiers de la Société.

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.

La méthodologie de swing pricing appliquée par la Société au cours de la période financière est cohérente avec celle appliquée dans les États financiers annuels audités.

Au 30 juin 2023, le swing pricing a été appliqué au Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund. Au 31 décembre 2022, le swing pricing a été appliqué au Fonds Income Fund II.

La VNI par action est indiquée à la Note 16 et peut inclure un ajustement de swing pricing. Les ajustements de swing pricing 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

La Société doit divulguer la hiérarchie de la juste valeur, distincte pour les actifs et les passifs, dans laquelle les évaluations de la juste valeur sont classées. 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'actif et de passif identiques.
- Niveau 2 — Autres données observables importantes 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 défaut) ou toute autre donnée corroborée par le marché.
- Niveau 3 — Données importantes 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.

L'évaluation de la valeur recouvrée attendue est fondée sur l'hypothèse qu'il est possible de recouvrer la juste valeur d'un actif existant, 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.

Le lecteur est renvoyé au Tableau des investissements pour l'analyse des actifs et passifs financiers de chaque Fonds, mesurés à la juste valeur au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022. La méthodologie appliquée par les Fonds à la classification des actifs et passifs financiers mesurés à la juste valeur en utilisant la hiérarchie de la juste valeur est conforme à celle appliquée aux États financiers annuels audités.

4. 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 la période close le 30 juin 2023 était de 277 072 633 \$/(139 559 \$) (30 juin 2022 : 15 018 247 \$/(1 166 271 \$)).

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Contrats de prise en pension au cours de la période close le 30 juin 2023 était de 204 499 \$/(66 620 552 \$) (30 juin 2022 : 8 488 913 \$/(9 218 518 \$)).

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos au cours de la période close le 30 juin 2023 était de 1 074 \$/(2 626 118 \$) (30 juin 2022 : 223 876 \$/(954 715 \$)).

5. POLITIQUE EN MATIÈRE DE DIVIDENDES

Comme stipulé dans le Supplément 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 frais, 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 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 des catégories 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, payés en espèces ou réinvestis 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, versés en espèces ou réinvestis en actions supplémentaires après déclaration.

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	Période close le 30 juin 2023	Période close le 30 juin 2022
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 0	\$ 50
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	311	32
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	94	1
Fonds Diversified Income Fund	2 113	6 698
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	1 240	1 317
Fonds Dynamic Bond Fund	811	331
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	€ 725	€ 2 994
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	\$ 2	\$ 0
Fonds Global Bond Fund	549	944
Fonds Global Bond ESG Fund	209	0
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	729	1 533
Fonds Global High Yield Bond Fund	501	1 504
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	21
Fonds Global Real Return Fund	5 083	883
Fonds Income Fund	5 888	191
Fonds Low Average Duration Fund	15	115
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	13	0
Fonds Low Duration Income Fund	3	0
Fonds Low Duration Opportunities Fund	1 716	772
Fonds Strategic Income Fund	1	0
Fonds Total Return Bond Fund	0	123
Fonds UK Corporate Bond Fund	£ 363	£ 319
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	9	67
Fonds US High Yield Bond Fund	\$ 1	\$ 0

6. 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 relevant de la Directive concernant les marchés d'instruments financiers (« MiFID ») ou soumis à des dispositions réglementaires équivalentes, 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.

7. 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

Notes relatives aux États financiers (suite)

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.

8. MODIFICATIONS DU PROSPECTUS, DE L'ACTE CONSTITUTIF ET DES STATUTS

Le 3 janvier 2023, les Suppléments des Fonds Low Duration Income Fund et Income Fund II ont été mis à jour afin de modifier les renoncations aux Frais de gestion.

À la même date, les Suppléments des Fonds Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, PIMCO Capital Securities Fund, PIMCO Global Core Asset Allocation Fund, UK Corporate Bond Fund, UK Long Term Corporate Bond Fund et Dynamic Multi Asset Fund ont été mis à jour afin de 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 renoncations aux Frais de gestion.

Le 19 avril 2023, les Suppléments des Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund, Inflation Multi-Asset Fund et PIMCO Global Core Asset Allocation Fund ont été mis à jour pour modifier la politique d'investissement, afin de préciser que les Fonds peuvent investir jusqu'à 20 % de leur actif net 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 PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund a été mis à jour afin de préciser que l'univers d'exposition aux matières premières du Fonds ne comprend pas la totalité des secteurs de l'énergie. Cette clarification a été recommandée par le Conseiller en investissement à titre d'amélioration du processus d'investissement global du Fonds et ne constitue en aucun cas une modification importante de la politique d'investissement du Fonds.

Le 16 mai, le Supplément du Fonds StocksPLUS™ Fund a été mis à jour afin de supprimer la directive d'investissement stipulant que le Fonds détiendra au minimum 50 % de titres à revenu fixe à règlement le jour même. En effet, la réglementation n'impose pas que cette directive d'investissement auto-imposée (historique) figure dans le Supplément et, indépendamment de la précision qui était ainsi apportée, le Compartiment est géré dans le respect des obligations de liquidité applicables aux OPCVM. Ce changement assure la cohérence du Supplément avec d'autres stratégies similaires et ne constitue en aucun cas une modification importante de la politique d'investissement.

Le 2 juin 2023, le Supplément du Fonds PIMCO Climate Bond Fund a été mis à jour afin de modifier les renoncations aux Frais de gestion.

Le 30 juin 2023, le Supplément du Fonds Euro Credit Fund a été mis à jour afin de prolonger d'un an la renonciation aux Frais de gestion de 25 points de base de la Catégorie H Institutions, jusqu'au 30 juin 2024.

L'Acte constitutif et les Statuts de la Société n'ont pas été modifiés au cours de la période.

9. 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 (tels que définis dans le Prospectus) pour chacun des Fonds s'accumulent à chaque Jour de négociation (tel que défini dans le Supplément du Fonds concerné) et sont exigibles chaque mois à terme échu. Le Gestionnaire peut verser tout ou partie des Frais de gestion aux Conseillers en investissement au titre des conseils en investissement et autres services fournis par ceux-ci et pour que les Conseillers en investissement paient les services d'administration, de garde et autres fournis aux Fonds 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 Institutions, Investisseurs, Administrations (%)	Catégorie H Institutions (%)	Catégories BE Détail BM Détail BN Détail 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 Capital Securities Fund	0,79	S/O	1,69	0,93	S/O
Fonds PIMCO Climate Bond Fund ⁽¹⁾	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⁾	0,95	S/O	1,85	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	S/O	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
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 PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	0,95	1,12	2,15	S/O	S/O
Fonds Global High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	S/O
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

	Catégories Institutions, G Investisseurs, Administrations (%)	Catégorie H Institutions (%)	Catégories BE Détail BM Détail BN Détail E, G Détail, M Détail, N Détail, T (%)	Catégorie R (%)	Catégorie W (%)
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 ⁽⁶⁾	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 ⁽⁷⁾	0,45	0,62	0,85	S/O	S/O

(1) Ce chiffre prend en compte un abandon de commission par le Gestionnaire à hauteur de 0,05 % pour la Catégorie Investisseurs du 31 mai 2021 au 31 mai 2023. Cet abandon de commission a expiré le 1^{er} juin 2023.

(2) Pour toutes les Catégories, le chiffre prend en compte un abandon de commission par le Gestionnaire au taux de 0,15 % par an (l'abandon de commission était de 0,30 % par an avant le 1^{er} juin 2023). L'abandon de commission prendra fin le 1^{er} 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 cette commission ou d'en réduire la portée pour toute période ultérieure.

(3) Le taux de la Catégorie H Institutions prend en compte un abandon de commission par le Gestionnaire à hauteur de 0,25 % par an. L'abandon de commission se prolongera jusqu'au 30 juin 2024 et prendra fin le 1^{er} juillet 2024.

(4) Les taux de la Catégorie Institutions et de la Catégorie E prennent en compte un abandon de commission par le Gestionnaire à un taux de 0,11 % par an à partir du 31 mai 2021. Cet abandon de commission expirera à compter du 19 janvier 2024.

(5) Les taux des Catégories Institutions et H Institutions prennent en compte un abandon de commission par le Gestionnaire de 0,14 % par an. Le taux de la Catégorie E tient compte d'un abandon de commission par le Gestionnaire au taux de 0,54 % par an. L'abandon de commission expirera à compter du 18 janvier 2024.

(6) Pour toutes les Catégories, le chiffre prend en compte un abandon de commission par le Gestionnaire au taux de 0,05 % par an. Les abandons de commissions resteront 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 abandons de commissions ou d'en réduire la portée pour toute période ultérieure.

(7) Les taux indiqués pour les Catégories E, G Détail et M Détail tiennent compte de l'abandon de commission par le Gestionnaire au taux de 0,30 % par an. Les abandons de commissions 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 ces abandons de commissions ou d'en réduire la portée pour toute période ultérieure.

Les Frais de gestion de tous les Fonds (à l'exception des Fonds Inflation Multi-Asset Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund et Strategic Income Fund) sont restés inchangés au cours des périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 2022, à l'exception des modifications apportées aux renoncements aux commissions indiquées 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. Sur cette commission plus élevée, le Gestionnaire peut payer les frais de distribution, d'intermédiaires et autres services rendus aux Actionnaires dans ces catégories d'actions des Fonds, directement ou indirectement par les distributeurs, sociétés de courtage, banques, intermédiaires financiers ou autres intermédiaires. Compte tenu de la nature fixe des Frais de gestion, le Gestionnaire, et non les actionnaires, prend le risque de toute augmentation du prix des services couverts par lesdits Frais de gestion. Il prend également le risque de la hausse des niveaux de frais afférents à ces services au-delà des Frais de gestion du fait de la 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 tout autre affilié 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 garde et autres services

Le Gestionnaire fournit et/ou aide à la fourniture de services d'administration, de garde 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. Ils peuvent comprendre les services de cotation par un courtier, les services de paiement et autres services de représentant local, la comptabilité, l'audit, les services juridiques et autres services professionnels, les 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 destinés 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 influer 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 indemnisations) et les jetons de présence et frais des Administrateurs indépendants de la Société et de leur conseiller.

La Société a versé des jetons de présence aux Administrateurs indépendants à hauteur de 90 000 € pour la période close le 30 juin 2023 (30 juin 2022 : 90 000 €). De plus, chaque Administrateur indépendant est remboursé de ses débours raisonnables. Les Administrateurs non indépendants ne sont pas habilités à séparer les rémunérations de leur mandat d'administrateur de la Société. Les honoraires des Administrateurs sont comptabilisés en « Autres charges » dans le Compte de résultat.

Frais de services 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 services sont calculés sur la base de 0,35 % par an de la VNI de chaque Fonds imputable aux Catégories Investisseurs. Les Frais de services sont restés inchangés au cours des périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 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'accroissent 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 services 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 renseignements 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'accroissent 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.

Les Frais de commercialisation sont restés inchangés au cours des périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 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 imputable 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'accroissent 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'excéderait pas 0,0049 % par an des actifs nets moyens de la Catégorie du Fonds (calculés quotidiennement) ; 2) n'excéderait pas le Montant de remboursement total ; 3) ne comporterait aucun montant déjà remboursé au Gestionnaire ; ou 4) n'aurait 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.

10. 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 9, le cas échéant.

Au 30 juin 2023, le Gestionnaire détenait 1 162 694 (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 affiliés »).

Les Fonds suivants détenaient des investissements croisés pendant la période close le 30 juin 2023. Ces investissements ont été éliminés aux fins de présentation du total des Fonds de la Société.

	30 juin 2023
Fonds	Investissements croisés
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 PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds US Short-Term 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 Dynamic Multi-Asset 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

	30 juin 2023
Fonds	Investissements croisés
Fonds Emerging Local Bond Fund	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Fonds Euro Income 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 Bond ESG Fund	Fonds Global Investment Grade Credit ESG 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 US Short-Term Fund
Fonds US High Yield Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Les Fonds suivants détenaient des investissements croisés au 31 décembre 2022. Ces investissements ont été éliminés aux fins de présentation du total de la Société dans le Bilan comparatif des Fonds.

	31 décembre 2022
Fonds	Investissements croisés
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 PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds US Short-Term 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 Dynamic Multi-Asset 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 Local Bond Fund	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Fonds Euro Income Bond Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds Global Bond Ex-US Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds UK Corporate Bond Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Global Bond ESG Fund	Fonds Global Investment Grade Credit ESG 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

	31 décembre 2022
Fonds	Investissements croisés
Global Investment Grade Credit Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
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 US Short-Term Fund
Fonds US High Yield Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Les Fonds suivants détenaient des investissements croisés pendant la période close le 30 juin 2022. Ces investissements ont été éliminés aux fins de présentation du total de la Société dans le Compte de résultat et dans l'État de l'évolution des actifs nets comparatifs des Fonds.

	30 juin 2022
Fonds	Investissements croisés
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 PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds US Short-Term 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 Emerging Markets Opportunities Fund
Fonds Emerging Local Bond Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Emerging Local Bond Fund	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Euro Income Bond Fund	Fonds US Short-Term 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 Bond ESG Fund	Fonds Global Investment Grade Credit ESG 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 Global Libor Plus Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Global Libor Plus Bond Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Low Average Duration Fund	Fonds US Short-Term 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 Investment Grade Corporate Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund

Certains Fonds investissent dans la Catégorie Z du Fonds PIMCO China Bond Fund, un compartiment de PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. et du Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, un compartiment de PIMCO Select Funds plc, qui sont considérés comme des Fonds affiliés. Du fait de la nature de la Catégorie Z et afin d'éviter la duplication des frais, les Frais de gestion de la Catégorie Z des deux fonds sont fixés à 0,00 % par an.

Notes relatives aux États financiers (suite)

Certains Fonds investissent dans les compartiments de PIMCO ETFs plc : PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF et PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, et ceux-ci sont considérés comme des Fonds affiliés. Étant donné que ces Fonds n'offrent pas de catégorie d'actions à commission nulle, les Frais de gestion sont payés par le Fonds investissant et 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 du Compte de résultat par les Conseillers en investissement.

Au cours des périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 2022, les Fonds ci-dessous ont participé à l'achat et à la vente de titres parmi les Fonds affiliés, à l'achat et à la vente de placements croisés et à l'achat et à la vente d'investissements dans des Fonds affiliés (montants en milliers) :

Fonds	30 juin 2023	
	Achats	Ventes
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 423 569	\$ 391 337
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	92 981	99 053
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	115 634	34 102
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	294	5 057
Fonds Commodity Real Return Fund	549	0
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	6 342	6 452
Fonds Diversified Income Fund	262 747	405 020
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	9 813	20 783
Fonds Diversified Income ESG Fund	5 821	833
Fonds Dynamic Bond Fund	78 348	82 000
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	5 681	97 503
Fonds Emerging Local Bond Fund	1 053 732	924 477
Fonds Emerging Markets Bond Fund	925 922	895 848
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	12 330	11 043
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	35 549	35 460
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	112 961	116 241
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	101	199
Fonds Euro Bond Fund	53 170	107 866
Fonds Euro Credit Fund	3 412	416
Fonds Euro Income Bond Fund	3 560	25 568
Fonds Euro Long Average Duration Fund	22 448	12 114
Fonds Euro Short-Term Fund	0	19 129
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	17 655	3 018
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	16 916	38 750
Fonds Global Advantage Fund	89 176	85 406
Fonds Global Bond Fund	611 120	554 590
Fonds Global Bond ESG Fund	11 942	7 052
Fonds Global Bond Ex-US Fund	230 398	227 009
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	125 641	140 601
Fonds Global High Yield Bond Fund	240 825	313 197
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	291 803	313 554
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	106 586	14 830
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	264 567	276 800
Fonds Global Real Return Fund	253 215	250 100
Fonds Income Fund	1 014 864	682 726
Fonds Income Fund II	60 466	54 600
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	52 735	59 781
Fonds Low Average Duration Fund	161 690	201 129
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	159 590	142 383
Fonds Low Duration Income Fund	62 826	24 129
Fonds Low Duration Opportunities Fund	176 229	206 029
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	1 116	3 600
Fonds Mortgage Opportunities Fund	0	665
Fonds StocksPLUS™ Fund	78 848	8 600
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	412	200
Fonds Strategic Income Fund	110 199	116 600
Fonds Total Return Bond Fund	705 326	744 063
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	141 935	153 703
Fonds UK Corporate Bond Fund	13 291	7 714

Fonds	30 juin 2023	
	Achats	Ventes
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	\$ 12 962	\$ 1 046
Fonds US High Yield Bond Fund	441 483	425 114
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	9 748	4 779
Fonds US Short-Term Fund	51 202	103 402

Fonds	30 juin 2022	
	Achats	Ventes
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 450 898	\$ 528 533
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	82 359	82 711
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	80 074	524 621
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	449	17 338
Fonds Commodity Real Return Fund	79 289	0
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	3 412	5 157
Fonds Diversified Income Fund	303 492	1 096 849
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	30 777	86 520
Fonds Dynamic Bond Fund	105 264	171 389
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	647	0
Fonds Emerging Local Bond Fund	886 434	905 374
Fonds Emerging Markets Bond Fund	476 521	763 429
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	185 351	65 552
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	50 466	53 126
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	72 028	68 693
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	796	952
Fonds Euro Bond Fund	255 645	189 222
Fonds Euro Credit Fund	80 048	111 228
Fonds Euro Income Bond Fund	209 995	297 005
Fonds Euro Long Average Duration Fund	5 104	4 123
Fonds Euro Short-Term Fund	30 546	42 154
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	4 107	6 694
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	34 936	36 870
Fonds Global Advantage Fund	91 947	77 527
Fonds Global Bond Fund	785 238	769 426
Fonds Global Bond ESG Fund	3 729	730
Fonds Global Bond Ex-US Fund	330 925	295 371
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	526 757	648 111
Fonds Global High Yield Bond Fund	634 659	964 028
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	1 864 705	2 994 709
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	59 019	63 891
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	114 718	122 898
Fonds Global Real Return Fund	352 063	281 345
Fonds Income Fund	632 501	1 884 444
Fonds Income Fund II	3 404	3 000
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	47 808	9 500
Fonds Low Average Duration Fund	315 626	247 122
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	182 053	155 605
Fonds Low Duration Income Fund	115 594	151 082
Fonds Low Duration Opportunities Fund	83 207	71 406
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	16 121	13 400
Fonds Mortgage Opportunities Fund	826 458	912 334
Fonds StocksPLUS™ Fund	30 955	317 619
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	201	400
Fonds Strategic Income Fund	139 264	118 155
Fonds Total Return Bond Fund	363 416	571 790
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	28 707	21 000
Fonds UK Corporate Bond Fund	7 714	6 714
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	6 832	10 266
Fonds US High Yield Bond Fund	720 899	966 445
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	151 908	163 585
Fonds US Short-Term Fund	415 891	385 870

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, en tant que parties liées de la Société, au-delà de 20 % de l'actif net du Fonds, au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022.

Fonds	30 juin 2023 % détenu	31 décembre 2022 % détenu
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	S/O	21,53
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	50,72	49,24
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	23,13	23,94
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	S/O	21,78
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	23,15	25,65
Fonds Diversified Income ESG Fund	100,00	100,00
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	25,09	25,10
Fonds Emerging Local Bond ESG Fund	94,33	100,00
Fonds Emerging Markets Bond Fund	23,64	22,87
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	51,79	57,57
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	27,64	26,22
Fonds Euro Credit Fund	30,97	30,16
Fonds Euro Income Bond Fund	24,12	21,29
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	68,63	98,78
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	24,76	31,55
Fonds Global Bond Ex-US Fund	20,34	S/O
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	61,38	65,44
Fonds Income Fund II	24,31	40,67
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	25,80	29,48
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	100,00	100,00
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	53,38	50,65
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	83,32	84,86
Fonds Strategic Income Fund	46,61	47,13
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	20,69	S/O
Fonds US Short-Term Fund	32,29	31,95

Au 30 juin 2023, le Fonds Income Fund détenait 9 694 BILLETS (31 décembre 2022 : 9 694 BILLETS) de BNP Paribas Issuance BV., garantis par des billets émis par Repack Bond Collateral Ltd. (« 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 au Conseiller en investissement. Aucune commission ne sera versée aux Conseillers en investissement par l'Entité.

Intérêts des Administrateurs et du Secrétaire en actions et contrats

Au 30 juin 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, 8 757,87 (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, qui sont tous des Fonds de la Société.

Au 30 juin 2023, Ryan P. Blute détenait 5 387,93 (31 décembre 2022 : 5 387,93) actions du Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 105 514,79 (31 décembre 2022 : 24 131,27) actions du Fonds Low Average Duration Fund et 215 070,39 (31 décembre 2022 : 82 494,63) actions du Fonds Low Duration Income Fund, qui sont tous des Fonds de la Société.

Au 30 juin 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 30 juin 2023, David M. Kennedy détenait 4 316,08 (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 Global Core Asset Allocation Fund, tous deux Fonds de la Société.

Aucun autre Administrateur ne détenait d'actions de la Société au cours des périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 2022.

Le Secrétaire ne détenait pas d'actions de la Société au cours des périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 2022.

La Société n'avait aucun employé au cours des périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 2022.

11. TRANSACTIONS 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 transactions avec des parties liées sont effectuées comme décrit plus haut et que les conditions y afférentes ont été respectées au cours de la période financière.

12. TAUX DE CHANGE

Aux fins de la consolidation des états financiers des Fonds, pour parvenir aux chiffres de la Société (requis en vertu de la loi irlandaise sur les sociétés), les montants figurant au Bilan ont été convertis au taux de change en vigueur au 30 juin 2023 de l'euro au dollar américain (USD/EUR : 0,91659) (31 décembre 2022 : USD/EUR : 0,93699) et de la livre sterling au dollar américain (USD/GBP : 0,78657) (31 décembre 2022 : USD/GBP : 0,83132). Les montants du Compte de résultat et de l'Etat de l'évolution des actifs nets ont été convertis au taux de change moyen pour la période close le 30 juin 2023, de l'euro au dollar américain (USD/EUR : 0,92567) (30 juin 2022 : USD/EUR : 0,91527) et de la livre sterling au dollar américain (USD/GBP : 0,81121) (30 juin 2022 : USD/GBP : 0,77097).

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 30 juin 2023 comprennent une décote de 97 % (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	30 juin 2023 Devise de présentation		
	EUR	GBP	USD
AED	S/O	S/O	3,67305
ARS	280,08777	S/O	256,72565
AUD	1,63900	1,90994	1,50229
BRL	5,26299	S/O	4,82400
CAD	1,44367	1,68231	1,32325
CHF	0,97606	S/O	0,89465
CLP	875,14592	S/O	802,15000
CNH	7,93681	9,24882	7,27480
CNY	7,92508	S/O	7,26405
COP	4555,77194	S/O	4175,77500
CZK	23,75855	S/O	21,77685
DKK	7,44591	8,67678	6,82485
DOP	S/O	S/O	55,09000
EGP	S/O	S/O	30,90000
EUR (ou €)	S/O	1,16531	0,91659
GBP (ou £)	0,85814	1,00000	0,78657
GHS	S/O	S/O	11,37500
HKD	8,54973	S/O	7,83660
HUF	373,00014	S/O	341,88820
IDR	16356,82257	S/O	14992,50000
ILS	4,04865	S/O	3,71095
INR	89,50158	S/O	82,03625
JPY (ou ¥)	157,68773	183,75468	144,53500
KES	S/O	S/O	140,60000
KRW	1437,55660	S/O	1317,65000
KZT	S/O	S/O	450,85500
MXN	18,71120	21,80430	17,15050

Notes relatives aux États financiers (suite)

Devise étrangère	30 juin 2023		
	Devise de présentation		
	EUR	GBP	USD
MYR	S/O	S/O	4,66750
NGN	S/O	S/O	765,50000
NOK	11,68849	13,62068	10,71355
NZD	1,78079	2,07517	1,63225
PEN	3,95466	S/O	3,62480
PHP	S/O	S/O	55,19950
PLN	4,43268	S/O	4,06295
RON	S/O	S/O	4,54560
RSD	S/O	S/O	107,50000
RUB	97,64453	S/O	89,50000
SEK	11,78422	13,73224	10,80130
SGD	1,47651	1,72058	1,35335
THB	S/O	S/O	35,45500
TRY	28,44238	33,14411	26,07000
TWD	33,97866	S/O	31,14450
UGX	S/O	S/O	3675,00000
USD (ou \$)	1,09100	1,27135	1,00000
UYU	S/O	S/O	37,37500
VND	S/O	S/O	23585,00000
ZAR	20,61036	24,01740	18,89125
ZMW	S/O	S/O	17,57500

Devise étrangère	31 décembre 2022		
	Devise de présentation		
	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

Devise étrangère	31 décembre 2022		
	Devise de présentation		
	EUR	GBP	USD
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

13. RISQUES FINANCIERS

Les activités des Fonds les exposent à divers risques financiers tels que le risque de marché (en ce compris le risque de cours, le risque de taux d'intérêt et le risque de change), le risque de crédit et le risque de liquidité.

Le processus global de gestion des risques des Fonds se concentre sur le caractère imprévisible des marchés financiers et vise à minimiser les effets défavorables potentiels sur la performance financière des Fonds. Veuillez vous reporter au Prospectus pour plus d'informations sur les différents risques auxquels le Fonds peut être exposé.

Les objectifs et politiques de gestion des risques financiers de la Société restent en cohérence avec ceux présentés dans les États financiers annuels audités de la Société portant sur l'exercice clos le 31 décembre 2022.

14. 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.

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 périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 2022 :

Fonds	30 juin 2023		30 juin 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	\$ 6 172 015	30,52	\$ 14 107 219	32,23
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	153 280	12,91	416 002	20,01
Fonds Commodity Real Return Fund	528 194	2,04	1 806 911	5,27
Fonds Diversified Income Fund	11 268 415	3,34	9 713 714	6,03
Fonds Emerging Local Bond Fund	863 206	2,11	1 380 942	3,20
Fonds Emerging Markets Bond Fund	844 035	5,55	1 558 214	7,00
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	53 663	2,76	40 078	5,17
Fonds Global Bond Fund	6 877 936	2,10	2 405 893	1,08
Fonds Global High Yield Bond Fund	903 931	4,69	791 283	2,95
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	5 551 222	3,04	1 014 463	0,97
Fonds Global Real Return Fund	356 843	0,81	569 391	0,71

Fonds	30 juin 2023		30 juin 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 Income Fund	\$ 248 076 525	12,74	\$ 12 902 695	1,00
Fonds Income Fund II	3 030	0,41	214	0,07
Fonds Low Average Duration Fund	689 689	4,27	1 304 128	2,66
Fonds Total Return Bond Fund	1 936 170	3,62	1 095 290	1,49
Fonds US High Yield Bond Fund	886 047	16,59	705 505	6,87

Aucune commission n'a été prélevée sur les transactions du tableau ci-dessus pour les périodes closes le 30 juin 2023 et 30 juin 2022.

Les actions détenues dans des Fonds agréés par la SFC par les Administrateurs de la Société au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 sont détaillées dans la Note 10. Les commissions versées aux Administrateurs de la Société pour les périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 2022 sont détaillées dans la Note 9.

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 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 est détaillée dans la Note 10. Les commissions versées au Gestionnaire, aux Conseillers en investissement et/ou aux Conseillers en investissement par délégation sont détaillées dans la Note 9 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 périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 2022. Comme indiqué à la Note 9, les commissions et frais du Dépositaire sont payés par le Gestionnaire à partir des Frais de gestion ou par les Conseillers en investissement. 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.

15. 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 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 information témoigne de la nature de l'activité de la Société en tant que fonds d'investissement.

(c) Actions de participation rachetables

Le capital-actions participatif émis est toujours égal à la VNI des Fonds. Les actions de participation rachetables sont rachetables au gré des actionnaires et classées en tant que passifs financiers.

16. 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 (VNI) par action de chacun des Fonds pour les trois dernières périodes 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 :

Actif net	Au 30 juin 2023		Au 31 déc. 2022		Au 31 déc. 2021	
	\$		\$		\$	
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund						
Actif net	\$ 2 796 171		\$ 2 981 392		\$ 3 411 923	
Institutions :						
Capitalisation	\$ 1 649 343		\$ 1 552 047		\$ 1 221 240	
Actions émises en circulation	186 773		174 453		117 953	
VNI par action	\$ 8,83		\$ 8,90		\$ 10,35	
Distribution	\$ 113 417		\$ 113 734		\$ 248 734	
Actions émises en circulation	16 783		16 032		28 125	
VNI par action	\$ 6,76		\$ 7,09		\$ 8,84	
Institutions en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD 2 594		AUD 203 422		AUD 12	
Actions émises en circulation	385		28 372		1	
VNI par action	AUD 6,74		AUD 7,17		AUD 9,00	
Institutions en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF 3 602		CHF 4 094		CHF 35 166	
Actions émises en circulation	477		527		3 797	
VNI par action	CHF 7,55		CHF 7,77		CHF 9,26	
Distribution	CHF 1 773		CHF 1 912		CHF 5 135	
Actions émises en circulation	279		281		591	
VNI par action	CHF 6,35		CHF 6,81		CHF 8,69	
Institutions en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€ 384 379		€ 498 977		€ 653 189	
Actions émises en circulation	50 131		63 739		70 200	
VNI par action	€ 7,67		€ 7,83		€ 9,30	
Distribution	€ 21 934		€ 27 728		€ 75 650	
Actions émises en circulation	3 413		4 056		8 695	
VNI par action	€ 6,43		€ 6,84		€ 8,70	
Institutions en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£ 14 268		£ 14 369		£ 18 246	
Actions émises en circulation	1 845		1 836		1 996	
VNI par action	£ 7,73		£ 7,83		£ 9,14	
Distribution	£ 17 753		£ 20 785		£ 59 979	
Actions émises en circulation	2 764		3 068		7 061	
VNI par action	£ 6,42		£ 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 2 479		SGD 385		SGD 85	
Actions émises en circulation	363		53		9	
VNI par action	SGD 6,84		SGD 7,23		SGD 9,01	
Investisseurs :						
Capitalisation	\$ 6 300		\$ 8 727		\$ 19 282	
Actions émises en circulation	848		1 164		2 201	
VNI par action	\$ 7,43		\$ 7,50		\$ 8,76	
Distribution	\$ 54 081		\$ 71 688		\$ 273 632	
Actions émises en circulation	8 161		10 304		31 566	
VNI par action	\$ 6,63		\$ 6,96		\$ 8,67	
Investisseurs en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD 3 720		AUD 3 889		AUD 5 081	
Actions émises en circulation	567		557		579	
VNI par action	AUD 6,57		AUD 6,99		AUD 8,77	

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023		Au 31 déc. 2022		Au 31 déc. 2021	
	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite)					
Investisseurs en EUR (couverte) :						
Distribution	€	1 013	€	873	€	935
Actions émises en circulation		161		130		110
VNI par action	€	6,29	€	6,69	€	8,52
Investisseurs en RMB (couverte) :						
Distribution	CNH	10 329	CNH	13 234	CNH	24 873
Actions émises en circulation		151		182		275
VNI par action	CNH	68,20	CNH	72,74	CNH	90,46
Investisseurs en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	4 259	SGD	4 112	SGD	6 528
Actions émises en circulation		647		591		753
VNI par action	SGD	6,58	SGD	6,96	SGD	8,67
Administrations :						
Distribution	\$	25 777	\$	28 245	\$	41 320
Actions émises en circulation		3 813		3 980		4 672
VNI par action	\$	6,76	\$	7,10	\$	8,84
Catégorie E :						
Capitalisation	\$	57 852	\$	61 585	\$	78 405
Actions émises en circulation		7 168		7 540		8 175
VNI par action	\$	8,07	\$	8,17	\$	9,59
Distribution	\$	56 607	\$	56 633	\$	100 159
Actions émises en circulation		8 375		7 981		11 325
VNI par action	\$	6,76	\$	7,10	\$	8,84
Catégorie E en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	913	CHF	1 012	CHF	1 263
Actions émises en circulation		124		133		138
VNI par action	CHF	7,37	CHF	7,63	CHF	9,16
Distribution	CHF	206	CHF	245	CHF	280
Actions émises en circulation		33		36		32
VNI par action	CHF	6,35	CHF	6,81	CHF	8,69
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	45 006	€	48 877	€	61 580
Actions émises en circulation		6 010		6 365		6 687
VNI par action	€	7,49	€	7,68	€	9,21
Distribution	€	9 724	€	8 314	€	10 041
Actions émises en circulation		1 513		1 217		1 154
VNI par action	€	6,42	€	6,83	€	8,70
Catégorie E en HKD (non couverte)						
Distribution	HKD	5 515	HKD	6 334	HKD	4 540
Actions émises en circulation		816		897		516
VNI par action	HKD	6,76	HKD	7,06	HKD	8,79
Catégorie E en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	14 008	SGD	15 239	SGD	25 623
Actions émises en circulation		2 106		2 168		2 924
VNI par action	SGD	6,65	SGD	7,03	SGD	8,76
H Institutions :						
Capitalisation	\$	1 312	\$	1 323	\$	182
Actions émises en circulation		172		172		20
VNI par action	\$	7,62	\$	7,69	\$	8,96
Distribution	\$	534	\$	547	\$	686
Actions émises en circulation		81		79		80
VNI par action	\$	6,57	\$	6,90	\$	8,60
M Détail :						
Distribution II	\$	21 565	\$	17 613	\$	22 700
Actions émises en circulation		3 415		2 637		2 684
VNI par action	\$	6,32	\$	6,68	\$	8,46
M Détail en HKD (non couverte) :						
Distribution II	HKD	3 879	HKD	1 797	HKD	6 482
Actions émises en circulation		615		270		771
VNI par action	HKD	6,30	HKD	6,65	HKD	8,41

	Au 30 juin 2023		Au 31 déc. 2022		Au 31 déc. 2021	
	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite)					
M Détail en SGD (couverte) :						
Distribution II	SGD	8 109	SGD	8 881	SGD	11 492
Actions émises en circulation		1 305		1 342		1 372
VNI par action	SGD	6,21	SGD	6,62	SGD	8,38
Catégorie Z :						
Capitalisation	\$	229 170	\$	230 136	\$	300 885
Actions émises en circulation		25 207		25 207		28 503
VNI par action	\$	9,09	\$	9,13	\$	10,56
	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund					
Actif net	\$	319 819	\$	313 987	\$	361 011
Institutions :						
Capitalisation	\$	11	S/O	S/O	S/O	S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	\$	9,95		S/O		S/O
Distribution	\$	53 839	\$	54 459	\$	64 997
Actions émises en circulation		6 797		6 776		6 958
VNI par action	\$	7,92	\$	8,04	\$	9,34
Institutions en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	9	S/O	S/O	S/O	S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	€	9,91		S/O		S/O
Distribution	€	98 102	€	97 916	€	102 975
Actions émises en circulation		12 864		12 495		11 068
VNI par action	€	7,63	€	7,84	€	9,30
Institutions en GBP (couverte) :						
Distribution	£	315	£	205	£	174
Actions émises en circulation		40		26		19
VNI par action	£	7,88	£	8,04	£	9,41
Institutions en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	7 861	SGD	3 799	SGD	5 354
Actions émises en circulation		987		467		566
VNI par action	SGD	7,96	SGD	8,13	SGD	9,46
Investisseurs :						
Capitalisation	\$	10	S/O	S/O	S/O	S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	\$	9,95		S/O		S/O
Investisseurs en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	9	S/O	S/O	S/O	S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	€	9,90		S/O		S/O
Catégorie E :						
Capitalisation	\$	2 846	\$	806	\$	12
Actions émises en circulation		327		94		1
VNI par action	\$	8,69	\$	8,62	\$	9,69
Distribution	\$	21 585	\$	24 409	\$	24 934
Actions émises en circulation		3 098		3 450		3 015
VNI par action	\$	6,97	\$	7,08	\$	8,27
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	6 035	€	5 640	€	5 060
Actions émises en circulation		731		680		532
VNI par action	€	8,26	€	8,29	€	9,51
Catégorie E en EUR (non couverte)						
Capitalisation	€	19 906	€	21 244	€	25 443
Actions émises en circulation		1 425		1 500		1 703
VNI par action	€	13,97	€	14,17	€	14,94
Catégorie E en HKD (non couverte)						
Distribution	HKD	2 970	HKD	2 973	HKD	3 401
Actions émises en circulation		372		367		362
VNI par action	HKD	7,99	HKD	8,09	HKD	9,40

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021	
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (suite)				
Catégorie E en SGD (couverte) :				
Distribution	SGD 2 948	SGD 300	SGD 337	
Actions émises en circulation	371	37	36	
VNI par action	SGD 7,95	SGD 8,13	SGD 9,46	
M Détail en HKD (non couverte) :				
Distribution	HKD 29 970	HKD 31 879	HKD 39 857	
Actions émises en circulation	4 921	5 174	5 540	
VNI par action	HKD 6,09	HKD 6,16	HKD 7,19	
Catégorie Z :				
Capitalisation	\$ 93 585	\$ 93 351	\$ 109 270	
Actions émises en circulation	10 471	10 610	11 219	
VNI par action	\$ 8,94	\$ 8,80	\$ 9,74	
Fonds PIMCO Capital Securities Fund				
Actif net	\$ 5 450 002	\$ 5 721 591	\$ 9 110 409	
Institutions :				
Capitalisation	\$ 1 300 577	\$ 1 352 729	\$ 2 296 596	
Actions émises en circulation	67 278	69 143	103 846	
VNI par action	\$ 19,33	\$ 19,56	\$ 22,12	
Distribution	\$ 271 371	\$ 393 584	\$ 728 260	
Actions émises en circulation	28 509	39 825	62 402	
VNI par action	\$ 9,52	\$ 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	
Institutions en BRL (couverte) :				
Capitalisation	\$ 12 281	\$ 25 163	\$ 47 342	
Actions émises en circulation	1 326	3 040	5 855	
VNI par action	\$ 9,26	\$ 8,28	\$ 8,09	
Institutions en CHF (couverte) :				
Capitalisation	CHF 37 804	CHF 52 485	CHF 120 911	
Actions émises en circulation	2 588	3 478	6 908	
VNI par action	CHF 14,61	CHF 15,09	CHF 17,50	
Institutions en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 1 176 914	€ 1 198 101	€ 1 868 333	
Actions émises en circulation	88 625	88 171	118 946	
VNI par action	€ 13,28	€ 13,59	€ 15,71	
Distribution	€ 415 915	€ 383 951	€ 481 884	
Actions émises en circulation	41 983	36 928	38 373	
VNI par action	€ 9,91	€ 10,40	€ 12,56	
Distribution II	€ 5 762	€ 31 417	€ 41 671	
Actions émises en circulation	769	3 979	4 334	
VNI par action	€ 7,49	€ 7,89	€ 9,61	
Institutions en GBP (couverte) :				
Capitalisation	£ 53 481	£ 35 494	£ 43 301	
Actions émises en circulation	3 852	2 518	2 696	
VNI par action	£ 13,89	£ 14,10	£ 16,06	
Distribution	£ 66 500	£ 67 663	£ 106 976	
Actions émises en circulation	6 300	6 132	8 135	
VNI par action	£ 10,56	£ 11,03	£ 13,15	

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021	
Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)				
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 1 030	SGD 178	SGD 39	
Actions émises en circulation	128	21	4	
VNI par action	SGD 8,03	SGD 8,38	SGD 9,91	
Investisseurs :				
Capitalisation	\$ 192 193	\$ 215 127	\$ 345 234	
Actions émises en circulation	14 647	16 173	22 879	
VNI par action	\$ 13,12	\$ 13,30	\$ 15,09	
Distribution	\$ 47 976	\$ 72 649	\$ 245 968	
Actions émises en circulation	5 063	7 387	21 180	
VNI par action	\$ 9,47	\$ 9,84	\$ 11,61	
Investisseurs en AUD (couverte) :				
Distribution	AUD 13 846	AUD 12 971	AUD 26 915	
Actions émises en circulation	1 605	1 437	2 496	
VNI par action	AUD 8,63	AUD 9,03	AUD 10,79	
Investisseurs en CAD (couverte) :				
Distribution	CAD 3 961	CAD 4 043	CAD 4 771	
Actions émises en circulation	441	432	431	
VNI par action	CAD 8,99	CAD 9,35	CAD 11,08	
Investisseurs en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 21 230	€ 23 367	€ 49 337	
Actions émises en circulation	1 842	1 978	3 601	
VNI par action	€ 11,53	€ 11,81	€ 13,70	
Investisseurs en GBP (couverte) :				
Distribution	£ 2 992	£ 2 695	£ 3 470	
Actions émises en circulation	368	319	344	
VNI par action	£ 8,13	£ 8,46	£ 10,08	
Investisseurs en RMB (couverte) :				
Distribution	S/O	CNH 31 763	CNH 39 482	
Actions émises en circulation	S/O	313	330	
VNI par action	S/O	CNH 101,51	CNH 119,51	
Investisseurs en SGD (couverte) :				
Distribution	SGD 5 179	SGD 5 849	SGD 5 321	
Actions émises en circulation	582	630	484	
VNI par action	SGD 8,90	SGD 9,29	SGD 10,99	
Administrations :				
Capitalisation	\$ 136 237	\$ 141 400	\$ 149 168	
Actions émises en circulation	7 428	7 599	7 057	
VNI par action	\$ 18,34	\$ 18,61	\$ 21,14	
Distribution	\$ 79 749	\$ 98 383	\$ 140 861	
Actions émises en circulation	6 230	7 402	8 978	
VNI par action	\$ 12,80	\$ 13,29	\$ 15,69	
Distribution II	\$ 10	\$ 10	S/O	
Actions émises en circulation	1	1	S/O	
VNI par action	\$ 9,19	\$ 9,60	S/O	
Administrations en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 13 978	€ 13 449	€ 18 966	
Actions émises en circulation	899	843	1 024	
VNI par action	€ 15,55	€ 15,95	€ 18,53	
Administrations en SGD (couverte) :				
Distribution II	SGD 13	SGD 14	S/O	
Actions émises en circulation	1	1	S/O	
VNI par action	SGD 9,13	SGD 9,59	S/O	
Catégorie E :				
Capitalisation	\$ 322 450	\$ 352 622	\$ 452 418	
Actions émises en circulation	23 981	25 798	29 018	
VNI par action	\$ 13,45	\$ 13,67	\$ 15,59	

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)			
Distribution	\$ 60 793	\$ 64 556	\$ 99 264
Actions émises en circulation	6 408	6 556	8 539
VNI par action	\$ 9,49	\$ 9,85	\$ 11,62
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 7 449	CHF 8 252	CHF 11 446
Actions émises en circulation	743	793	940
VNI par action	CHF 10,03	CHF 10,41	CHF 12,18
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 418 303	€ 402 295	€ 497 935
Actions émises en circulation	36 492	34 146	36 232
VNI par action	€ 11,46	€ 11,78	€ 13,74
Distribution	€ 62 231	€ 62 789	€ 73 090
Actions émises en circulation	7 625	7 332	7 069
VNI par action	€ 8,16	€ 8,56	€ 10,34
M Détail :			
Distribution II	\$ 202 342	\$ 218 883	\$ 306 306
Actions émises en circulation	24 108	24 922	29 067
VNI par action	\$ 8,39	\$ 8,78	\$ 10,54
M Détail en HKD (non couverte) :			
Distribution	HKD 2 710	HKD 2 801	HKD 24 499
Actions émises en circulation	298	298	2 211
VNI par action	HKD 9,10	HKD 9,40	HKD 11,08
M Détail en SGD (couverte) :			
Distribution II	SGD 90 625	SGD 100 715	SGD 145 278
Actions émises en circulation	11 028	11 653	13 981
VNI par action	SGD 8,22	SGD 8,64	SGD 10,39
Catégorie R :			
Distribution	\$ 4 322	\$ 4 980	\$ 6 177
Actions émises en circulation	452	501	526
VNI par action	\$ 9,57	\$ 9,94	\$ 11,73
Catégorie R en EUR (couverte) :			
Distribution	€ 3 129	€ 3 708	€ 12 422
Actions émises en circulation	394	445	1 233
VNI par action	€ 7,94	€ 8,33	€ 10,07
Catégorie R en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 2 450	£ 2 795	£ 5 957
Actions émises en circulation	288	315	564
VNI par action	£ 8,51	£ 8,86	£ 10,56
Catégorie T :			
Distribution	\$ 7 991	\$ 8 517	\$ 11 570
Actions émises en circulation	817	839	966
VNI par action	\$ 9,78	\$ 10,15	\$ 11,98
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 62 881	€ 65 092	€ 84 896
Actions émises en circulation	6 075	6 106	6 800
VNI par action	€ 10,35	€ 10,66	€ 12,48
Catégorie Z :			
Distribution	\$ 88 523	\$ 78 203	\$ 124 585
Actions émises en circulation	8 463	7 202	9 705
VNI par action	\$ 10,46	\$ 10,86	\$ 12,84
Catégorie Z en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 75 526	AUD 104 790	AUD 127 724
Actions émises en circulation	8 302	11 002	11 223
VNI par action	AUD 9,10	AUD 9,52	AUD 11,38
Fonds PIMCO Climate Bond Fund			
Actif net	\$ 289 524	\$ 292 655	\$ 328 081
Institutions :			
Capitalisation	\$ 24 922	\$ 27 502	\$ 21 317
Actions émises en circulation	2 764	3 116	2 108
VNI par action	\$ 9,02	\$ 8,83	\$ 10,11

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)			
Institutions en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 375	S/O	S/O
Actions émises en circulation	38	S/O	S/O
VNI par action	AUD 9,89	S/O	S/O
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 743	CHF 940	CHF 1 103
Actions émises en circulation	88	112	111
VNI par action	CHF 8,43	CHF 8,42	CHF 9,91
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 43 163	€ 62 757	€ 80 658
Actions émises en circulation	5 003	7 351	8 066
VNI par action	€ 8,63	€ 8,54	€ 10,00
Distribution	€ 103 157	€ 73 780	€ 101 819
Actions émises en circulation	12 550	8 951	10 361
VNI par action	€ 8,22	€ 8,24	€ 9,83
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 29 465	£ 32 441	£ 28 217
Actions émises en circulation	3 323	3 720	2 799
VNI par action	£ 8,87	£ 8,72	£ 10,08
Distribution	£ 34 174	£ 25 204	£ 715
Actions émises en circulation	4 035	2 978	72
VNI par action	£ 8,47	£ 8,46	£ 9,97
Institutions en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 17 101	SEK 290 215	SEK 292 047
Actions émises en circulation	198	3 406	2 939
VNI par action	SEK 86,16	SEK 85,22	SEK 99,36
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 5 460	SGD 5 576	SGD 5 453
Actions émises en circulation	612	635	541
VNI par action	SGD 8,92	SGD 8,78	SGD 10,08
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 10	S/O	\$ 3 214
Actions émises en circulation	1	S/O	321
VNI par action	\$ 10,11	S/O	\$ 10,00
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 74	SEK 73	SEK 86
Actions émises en circulation	1	1	1
VNI par action	SEK 85,55	SEK 84,84	SEK 99,39
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 15 890	€ 15 976	€ 16 979
Actions émises en circulation	1 888	1 909	1 718
VNI par action	€ 8,42	€ 8,37	€ 9,88
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 9	\$ 9	\$ 10
Actions émises en circulation	1	1	1
VNI par action	\$ 9,15	\$ 8,93	\$ 10,18
Fonds Commodity Real Return Fund			
Actif net	\$ 973 166	\$ 1 369 877	\$ 1 444 182
Institutions :			
Capitalisation	\$ 332 647	\$ 397 781	\$ 587 333
Actions émises en circulation	37 836	41 220	67 481
VNI par action	\$ 8,79	\$ 9,65	\$ 8,70
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 129 132	€ 225 302	€ 144 220
Actions émises en circulation	15 315	23 996	16 678
VNI par action	€ 8,43	€ 9,39	€ 8,65

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Commodity Real Return Fund (suite)			
Institutions en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 70 554	€ 87 086	€ 48 990
Actions émises en circulation	5 933	6 527	4 337
VNI par action	€ 11,89	€ 13,34	€ 11,29
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 21 791	£ 39 019	£ 36 172
Actions émises en circulation	1 827	2 963	3 012
VNI par action	£ 11,93	£ 13,17	£ 12,01
Institutions en GBP (non couverte) :			
Distribution	£ 18 858	£ 17 587	S/O
Actions émises en circulation	2 399	1 881	S/O
VNI par action	£ 7,86	£ 9,35	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 29 792	\$ 50 111	\$ 64 377
Actions émises en circulation	3 936	6 022	8 546
VNI par action	\$ 7,57	\$ 8,32	\$ 7,53
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 184 950	\$ 260 353	\$ 256 747
Actions émises en circulation	26 419	33 734	36 552
VNI par action	\$ 7,00	\$ 7,72	\$ 7,02
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 139 271	€ 238 920	€ 234 570
Actions émises en circulation	21 684	33 254	35 127
VNI par action	€ 6,42	€ 7,18	€ 6,68
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 1 240	SGD 2 069	SGD 352
Actions émises en circulation	122	183	34
VNI par action	SGD 10,19	SGD 11,30	SGD 10,32
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 3 379	\$ 3 614	S/O
Actions émises en circulation	439	427	S/O
VNI par action	\$ 7,70	\$ 8,46	S/O
Fonds PIMCO Credit Opportunités Bond Fund			
Actif net	\$ 99 796	\$ 97 153	\$ 139 704
Institutions :			
Capitalisation	\$ 47 267	\$ 44 986	\$ 47 099
Actions émises en circulation	3 372	3 318	3 345
VNI par action	\$ 14,02	\$ 13,56	\$ 14,07
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 13 196	CHF 15 367	CHF 22 488
Actions émises en circulation	1 272	1 500	2 060
VNI par action	CHF 10,37	CHF 10,24	CHF 10,92
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 16 955	€ 15 443	€ 39 139
Actions émises en circulation	1 410	1 312	3 136
VNI par action	€ 12,02	€ 11,77	€ 12,48
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 8 613	\$ 8 985	\$ 9 740
Actions émises en circulation	748	803	831
VNI par action	\$ 11,52	\$ 11,20	\$ 11,73
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 9 778	€ 9 455	€ 12 026
Actions émises en circulation	987	971	1 154
VNI par action	€ 9,91	€ 9,74	€ 10,42

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Diversified Income Fund			
Actif net	\$ 7 942 717	\$ 8 751 796	\$ 16 447 733
Institutions :			
Capitalisation	\$ 660 058	\$ 824 847	\$ 1 243 637
Actions émises en circulation	27 223	35 047	44 236
VNI par action	\$ 24,25	\$ 23,54	\$ 28,11
Distribution	\$ 290 580	\$ 352 231	\$ 692 397
Actions émises en circulation	22 875	27 897	44 132
VNI par action	\$ 12,70	\$ 12,63	\$ 15,69
Institutions en CAD (couverte) :			
Capitalisation	CAD 433 652	CAD 441 412	CAD 571 190
Actions émises en circulation	43 275	45 218	48 824
VNI par action	CAD 10,02	CAD 9,76	CAD 11,70
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 13 343	CHF 15 646	CHF 20 277
Actions émises en circulation	1 099	1 299	1 371
VNI par action	CHF 12,14	CHF 12,04	CHF 14,79
Distribution	CHF 5 675	CHF 8 022	CHF 13 028
Actions émises en circulation	798	1 111	1 412
VNI par action	CHF 7,11	CHF 7,22	CHF 9,23
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 990 830	€ 998 452	€ 1 703 682
Actions émises en circulation	63 613	65 216	90 940
VNI par action	€ 15,58	€ 15,31	€ 18,73
Distribution	€ 274 970	€ 330 342	€ 852 032
Actions émises en circulation	35 726	42 647	86 306
VNI par action	€ 7,70	€ 7,75	€ 9,87
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 506 486	£ 572 158	£ 1 248 141
Actions émises en circulation	38 852	44 993	81 268
VNI par action	£ 13,04	£ 12,72	£ 15,36
Distribution	£ 357 074	£ 391 080	£ 601 893
Actions émises en circulation	61 740	67 375	81 620
VNI par action	£ 5,78	£ 5,80	£ 7,37
Institutions en MXN (couverte) :			
Capitalisation	MXN 454 939	MXN 270 310	MXN 299 232
Actions émises en circulation	4 515	2 863	2 831
VNI par action	MXN 100,76	MXN 94,40	MXN 105,70
Institutions en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 168 763	SEK 168 340	SEK 205 009
Actions émises en circulation	1 041	1 058	1 057
VNI par action	SEK 162,09	SEK 159,10	SEK 193,88
Institutions en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 42 224	SGD 43 716	SGD 79 938
Actions émises en circulation	5 185	5 366	7 873
VNI par action	SGD 8,14	SGD 8,15	SGD 10,15
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 41 904	\$ 53 597	\$ 83 045
Actions émises en circulation	3 415	4 492	5 806
VNI par action	\$ 12,27	\$ 11,93	\$ 14,30

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Diversified Income Fund (suite)			
Distribution	\$ 95 900	\$ 89 559	\$ 69 026
Actions émises en circulation	11 171	10 495	6 522
VNI par action	\$ 8,59	\$ 8,53	\$ 10,58
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 19 159	€ 21 418	€ 34 903
Actions émises en circulation	1 301	1 477	1 960
VNI par action	€ 14,73	€ 14,50	€ 17,81
Distribution	€ 9 462	€ 10 066	€ 11 743
Actions émises en circulation	1 300	1 375	1 260
VNI par action	€ 7,28	€ 7,32	€ 9,32
Administrations :			
Distribution	\$ 85 505	\$ 87 885	\$ 143 334
Actions émises en circulation	9 121	9 431	12 385
VNI par action	\$ 9,37	\$ 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	€ 3 818	€ 4 330	€ 10 014
Actions émises en circulation	266	306	575
VNI par action	€ 14,37	€ 14,16	€ 17,42
Administrations en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 7 732	£ 8 358	£ 12 610
Actions émises en circulation	898	972	1 168
VNI par action	£ 8,61	£ 8,60	£ 10,80
Administrations en JPY (couverte) :			
Capitalisation	¥ 354 765	¥ 354 957	¥ 47 222
Actions émises en circulation	438	438	47
VNI par action	¥ 811,00	¥ 811,00	¥ 1 002,00
Administrations en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 70	SEK 78	SEK 84
Actions émises en circulation	1	1	1
VNI par action	SEK 82,08	SEK 80,78	SEK 98,94
Administrations en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 58 934	SGD 55 693	SGD 101 850
Actions émises en circulation	7 030	6 640	9 757
VNI par action	SGD 8,38	SGD 8,39	SGD 10,44
BM Détail :			
Distribution II	\$ 11 256	\$ 9	S/O
Actions émises en circulation	1 236	1	S/O
VNI par action	\$ 9,11	\$ 9,17	S/O
BN Détail :			
Distribution II	\$ 10	\$ 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	\$ 9,10	\$ 9,17	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 600 086	\$ 655 637	\$ 1 113 069
Actions émises en circulation	28 862	32 342	45 554
VNI par action	\$ 20,79	\$ 20,27	\$ 24,43
Distribution	\$ 317 720	\$ 372 507	\$ 630 798
Actions émises en circulation	28 007	33 038	45 041
VNI par action	\$ 11,34	\$ 11,28	\$ 14,01
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 6 066	CHF 7 655	CHF 9 701
Actions émises en circulation	725	918	939
VNI par action	CHF 8,37	CHF 8,34	CHF 10,33
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 983 703	€ 1 292 425	€ 1 880 735
Actions émises en circulation	72 415	96 369	113 579
VNI par action	€ 13,58	€ 13,41	€ 16,56
Distribution	€ 678 307	€ 781 155	€ 1 366 978
Actions émises en circulation	77 231	88 377	121 500
VNI par action	€ 8,78	€ 8,84	€ 11,25

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Diversified Income Fund (suite)			
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 19 184	SGD 22 377	SGD 47 272
Actions émises en circulation	2 364	2 757	4 674
VNI par action	SGD 8,12	SGD 8,12	SGD 10,11
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 515 828	\$ 385 630	\$ 1 501 526
Actions émises en circulation	28 222	21 717	70 674
VNI par action	\$ 18,28	\$ 17,76	\$ 21,25
Distribution	\$ 170	\$ 118	\$ 26
Actions émises en circulation	20	14	2
VNI par action	\$ 8,66	\$ 8,61	\$ 10,70
M Détail :			
Distribution	\$ 139 867	\$ 150 260	\$ 246 412
Actions émises en circulation	14 412	15 573	20 577
VNI par action	\$ 9,70	\$ 9,65	\$ 11,98
Distribution II	\$ 174 305	\$ 183 635	\$ 311 977
Actions émises en circulation	22 557	23 717	31 930
VNI par action	\$ 7,73	\$ 7,74	\$ 9,77
M Détail en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 47 073	AUD 49 591	AUD 83 307
Actions émises en circulation	5 309	5 574	7 442
VNI par action	AUD 8,87	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	\$ 8,83	\$ 8,61	\$ 10,38
Catégorie T :			
Capitalisation	\$ 24 245	\$ 25 356	\$ 40 854
Actions émises en circulation	2 165	2 318	3 086
VNI par action	\$ 11,20	\$ 10,94	\$ 13,24
Distribution	\$ 6 556	\$ 6 829	\$ 9 630
Actions émises en circulation	736	771	876
VNI par action	\$ 8,91	\$ 8,85	\$ 11,00
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 36 624	€ 36 445	€ 53 705
Actions émises en circulation	3 861	3 883	4 616
VNI par action	€ 9,49	€ 9,38	€ 11,63
Distribution	€ 19 186	€ 19 507	€ 28 295
Actions émises en circulation	2 550	2 576	2 937
VNI par action	€ 7,52	€ 7,57	€ 9,63
Catégorie W :			
Capitalisation	\$ 31 798	\$ 64 400	\$ 120 525
Actions émises en circulation	3 535	7 380	11 579
VNI par action	\$ 9,00	\$ 8,73	\$ 10,41
Distribution	\$ 13 371	\$ 45 458	\$ 137 527
Actions émises en circulation	1 659	5 672	13 806
VNI par action	\$ 8,06	\$ 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 3 197	CHF 10 994	CHF 13 719
Actions émises en circulation	380	1 317	1 339
VNI par action	CHF 8,42	CHF 8,35	CHF 10,24
Distribution	CHF 422	CHF 699	CHF 1 588
Actions émises en circulation	56	91	162
VNI par action	CHF 7,56	CHF 7,67	CHF 9,80

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Diversified Income Fund (suite)			
Catégorie W en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 6 262	€ 11 937	€ 15 286
Actions émises en circulation	732	1 420	1 488
VNI par action	€ 8,56	€ 8,40	€ 10,27
Distribution	€ 1 414	€ 3 382	€ 6 737
Actions émises en circulation	184	438	685
VNI par action	€ 7,67	€ 7,72	€ 9,83
Catégorie W en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 570	£ 2 089	£ 2 371
Actions émises en circulation	65	243	229
VNI par action	£ 8,81	£ 8,59	£ 10,36
Distribution	£ 323	£ 2 895	£ 3 547
Actions émises en circulation	41	367	358
VNI par action	£ 7,90	£ 7,89	£ 9,92
Catégorie W en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 1 533	SGD 3 079	SGD 4 762
Actions émises en circulation	192	385	477
VNI par action	SGD 8,00	SGD 8,00	SGD 9,97
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund			
Actif net	\$ 521 567	\$ 564 684	\$ 1 305 365
Institutions :			
Capitalisation	\$ 20 919	\$ 23 243	\$ 64 311
Actions émises en circulation	1 401	1 617	4 288
VNI par action	\$ 14,93	\$ 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	€ 73 149	€ 87 225	€ 165 664
Actions émises en circulation	5 603	6 863	12 228
VNI par action	€ 13,05	€ 12,71	€ 13,55
Distribution II	€ 9 698	€ 9 995	€ 40 816
Actions émises en circulation	1 340	1 372	5 012
VNI par action	€ 7,24	€ 7,29	€ 8,14
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 184 957	£ 182 935	£ 312 905
Actions émises en circulation	12 832	13 134	21 396
VNI par action	£ 14,42	£ 13,93	£ 14,62
Distribution	£ 42 282	£ 63 760	£ 176 678
Actions émises en circulation	5 315	7 894	19 855
VNI par action	£ 7,96	£ 8,08	£ 8,90
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 5 129	\$ 5 125	\$ 11 010
Actions émises en circulation	413	428	878
VNI par action	\$ 12,42	\$ 11,98	\$ 12,54
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 18 726	\$ 24 033	\$ 46 891
Actions émises en circulation	1 547	2 054	3 805
VNI par action	\$ 12,10	\$ 11,70	\$ 12,32
Distribution	\$ 31 528	\$ 33 306	\$ 38 488
Actions émises en circulation	3 362	3 579	3 808
VNI par action	\$ 9,38	\$ 9,30	\$ 10,11
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 43 302	€ 54 593	€ 184 920
Actions émises en circulation	3 642	4 696	14 788
VNI par action	€ 11,89	€ 11,63	€ 12,50
Distribution	€ 17 174	€ 18 931	€ 29 006
Actions émises en circulation	2 285	2 511	3 466
VNI par action	€ 7,51	€ 7,54	€ 8,37

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Diversified Income ESG Fund			
Actif net	\$ 57 989	\$ 9 854	
Institutions :			
Capitalisation	\$ 9 677	\$ 9 367	S/O
Actions émises en circulation	947	947	S/O
VNI par action	\$ 10,22	\$ 9,89	S/O
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 44 038	€ 226	S/O
Actions émises en circulation	4 418	23	S/O
VNI par action	€ 9,97	€ 9,76	S/O
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 194	£ 188	S/O
Actions émises en circulation	19	19	S/O
VNI par action	£ 10,11	£ 9,83	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 10	\$ 10	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	\$ 10,14	\$ 9,85	S/O
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 9	€ 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	€ 9,88	€ 9,73	S/O
Fonds Dynamic Bond Fund			
Actif net	\$ 3 367 293	\$ 3 483 601	\$ 3 277 997
Institutions :			
Capitalisation	\$ 311 552	\$ 470 460	\$ 626 628
Actions émises en circulation	22 406	34 671	42 473
VNI par action	\$ 13,90	\$ 13,57	\$ 14,75
Distribution	\$ 83 077	\$ 81 771	\$ 100 397
Actions émises en circulation	8 135	8 057	8 882
VNI par action	\$ 10,21	\$ 10,15	\$ 11,30
Institutions en CAD (couverte) :			
Capitalisation	CAD 11 508	CAD 11 952	CAD 15 351
Actions émises en circulation	1 117	1 186	1 398
VNI par action	CAD 10,30	CAD 10,08	CAD 10,98
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 55 726	CHF 70 173	CHF 87 168
Actions émises en circulation	5 594	7 073	7 873
VNI par action	CHF 9,96	CHF 9,92	CHF 11,07
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 104 271	€ 187 622	€ 348 406
Actions émises en circulation	8 689	15 837	26 481
VNI par action	€ 12,00	€ 11,85	€ 13,16
Distribution	€ 6 326	€ 11 318	€ 12 768
Actions émises en circulation	721	1 283	1 272
VNI par action	€ 8,78	€ 8,82	€ 10,04
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 1 873 362	£ 1 840 373	£ 887 562
Actions émises en circulation	152 222	152 611	67 216
VNI par action	£ 12,31	£ 12,06	£ 13,20

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023		Au 31 déc. 2022		Au 31 déc. 2021	
	Fonds Dynamic Bond Fund (suite)					
Distribution	£	90 524	£	94 155	£	253 262
Actions émises en circulation		10 514		10 906		26 086
VNI par action	£	8,61	£	8,63	£	9,71
Institutions en NOK (couverte) :						
Capitalisation	NOK	3 375	NOK	4 066	NOK	131 604
Actions émises en circulation		276		337		9 965
VNI par action	NOK	12,25	NOK	12,07	NOK	13,21
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	\$	42 841	\$	46 677	\$	56 790
Actions émises en circulation		3 651		4 069		4 537
VNI par action	\$	11,73	\$	11,47	\$	12,52
Distribution	\$	1 442	\$	2 830	\$	3 932
Actions émises en circulation		158		312		389
VNI par action	\$	9,14	\$	9,08	\$	10,11
Investisseurs en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	2 036	€	2 013	€	5 744
Actions émises en circulation		200		200		512
VNI par action	€	10,19	€	10,08	€	11,23
Administrations :						
Capitalisation	\$	16 282	\$	21 094	\$	29 563
Actions émises en circulation		1 253		1 659		2 128
VNI par action	\$	13,00	\$	12,72	\$	13,90
Administrations en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	640	€	1 170	€	3 659
Actions émises en circulation		57		105		295
VNI par action	€	11,22	€	11,11	€	12,40
Administrations en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	58 609	SEK	61 257	SEK	81 744
Actions émises en circulation		565		597		718
VNI par action	SEK	103,78	SEK	102,58	SEK	113,88
Catégorie E :						
Capitalisation	\$	69 275	\$	69 989	\$	92 812
Actions émises en circulation		6 165		6 354		7 680
VNI par action	\$	11,24	\$	11,01	\$	12,08
Distribution	\$	14 849	\$	14 979	\$	19 242
Actions émises en circulation		1 590		1 615		1 862
VNI par action	\$	9,34	\$	9,28	\$	10,33
Catégorie E en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	8 002	CHF	8 868	CHF	10 761
Actions émises en circulation		903		1 000		1 078
VNI par action	CHF	8,86	CHF	8,86	CHF	9,98
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	70 270	€	73 068	€	138 697
Actions émises en circulation		6 614		6 936		11 750
VNI par action	€	10,62	€	10,54	€	11,80
Catégorie E en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£	2 845	£	3 354	£	3 820
Actions émises en circulation		265		318		328
VNI par action	£	10,72	£	10,55	£	11,65
G Détail en EUR (couverte) :						
Distribution	€	6 677	€	7 061	€	8 905
Actions émises en circulation		840		896		992
VNI par action	€	7,95	€	7,88	€	8,98
H Institutions :						
Capitalisation	\$	7 808	\$	11 541	\$	18 571
Actions émises en circulation		750		1 135		1 677
VNI par action	\$	10,42	\$	10,17	\$	11,08

	Au 30 juin 2023		Au 31 déc. 2022		Au 31 déc. 2021	
	Fonds Dynamic Bond Fund (suite)					
Distribution	\$	10	\$	10	\$	11
Actions émises en circulation		1		1		1
VNI par action	\$	9,18	\$	9,12	\$	10,16
Catégorie R :						
Capitalisation	\$	5 881	\$	6 385	\$	7 736
Actions émises en circulation		519		577		642
VNI par action	\$	11,34	\$	11,07	\$	12,05
Catégorie Z :						
Capitalisation	\$	6 879	\$	6 683	\$	9 940
Actions émises en circulation		725		725		1 001
VNI par action	\$	9,49	\$	9,22	\$	9,93
Catégorie Z en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD	20 723	AUD	27 023	AUD	36 313
Actions émises en circulation		2 256		2 938		3 513
VNI par action	AUD	9,19	AUD	9,20	AUD	10,34
	Fonds Dynamic Multi-Asset Fund					
Actif net	€	4 258 211	€	5 115 170	€	7 635 950
Institutions :						
Capitalisation	€	1 378 749	€	1 644 656	€	2 765 020
Actions émises en circulation		117 482		137 719		198 997
VNI par action	€	11,74	€	11,94	€	13,89
Distribution II	€	150 789	€	158 729	€	238 007
Actions émises en circulation		14 079		14 419		18 212
VNI par action	€	10,71	€	11,01	€	13,07
Institutions en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	2 653	CHF	3 063	CHF	5 282
Actions émises en circulation		264		297		438
VNI par action	CHF	10,04	CHF	10,31	CHF	12,06
Institutions en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£	491 171	£	552 226	£	576 557
Actions émises en circulation		39 313		43 745		39 733
VNI par action	£	12,49	£	12,62	£	14,51
Distribution	£	22 493	£	33 675	£	17 109
Actions émises en circulation		2 083		3 025		1 337
VNI par action	£	10,80	£	11,13	£	12,79
Institutions en ILS (couverte) :						
Capitalisation	ILS	17 381	ILS	4 206		S/O
Actions émises en circulation		1 768		423		S/O
VNI par action	ILS	9,83	ILS	9,93		S/O
Institutions en SGD (couverte) :						
Capitalisation	SGD	108 401	SGD	109 428	SGD	27 017
Actions émises en circulation		12 511		12 486		2 702
VNI par action	SGD	8,66	SGD	8,76	SGD	10,00
Institutions en USD (couverte) :						
Capitalisation	\$	137 175	\$	156 343	\$	281 670
Actions émises en circulation		10 077		11 438		18 087
VNI par action	\$	13,61	\$	13,67	\$	15,57
Distribution II	\$	4 367	\$	4 450	\$	5 074
Actions émises en circulation		531		531		512
VNI par action	\$	8,22	\$	8,38	\$	9,92

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)			
Investisseurs :			
Capitalisation	€ 10 506	€ 10 626	€ 11 030
Actions émises en circulation	1 149	1 140	1 013
VNI par action	€ 9,15	€ 9,32	€ 10,89
Investisseurs en USD (couverte) :			
Capitalisation	\$ 9	\$ 9	\$ 10
Actions émises en circulation	1	1	1
VNI par action	\$ 8,89	\$ 8,94	\$ 10,22
BM Détail en AUD (couverte) :			
Distribution II	AUD 82	AUD 12	S/O
Actions émises en circulation	9	1	S/O
VNI par action	AUD 8,83	AUD 9,19	S/O
BM Détail en USD (couverte) :			
Distribution II	\$ 444	\$ 9	S/O
Actions émises en circulation	50	1	S/O
VNI par action	\$ 8,97	\$ 9,25	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 1 491 335	€ 1 913 579	€ 2 955 626
Actions émises en circulation	137 037	171 934	225 981
VNI par action	€ 10,88	€ 11,13	€ 13,08
Distribution	€ 3 967	€ 4 679	€ 5 627
Actions émises en circulation	440	506	517
VNI par action	€ 9,02	€ 9,25	€ 10,87
Catégorie E en USD (couverte) :			
Capitalisation	\$ 161 299	\$ 192 230	\$ 275 658
Actions émises en circulation	14 104	16 657	20 756
VNI par action	\$ 11,44	\$ 11,54	\$ 13,28
Distribution	\$ 32	\$ 32	\$ 10
Actions émises en circulation	4	4	1
VNI par action	\$ 8,73	\$ 8,84	\$ 10,18
Distribution II	\$ 8	\$ 9	\$ 10
Actions émises en circulation	1	1	1
VNI par action	\$ 8,08	\$ 8,27	\$ 9,80
H Institutions en USD (couverte) :			
Capitalisation	\$ 1 990	\$ 2 298	\$ 8 850
Actions émises en circulation	209	240	810
VNI par action	\$ 9,53	\$ 9,58	\$ 10,93
M Détail en AUD (couverte) :			
Distribution II	AUD 448	AUD 321	AUD 563
Actions émises en circulation	57	39	57
VNI par action	AUD 7,89	AUD 8,17	AUD 9,87
M Détail en SGD (couverte) :			
Distribution II	SGD 11 098	SGD 12 812	SGD 16 539
Actions émises en circulation	1 377	1 538	1 673
VNI par action	SGD 8,06	SGD 8,33	SGD 9,89
M Détail en USD (couverte) :			
Distribution II	\$ 54 997	\$ 65 622	\$ 120 842
Actions émises en circulation	6 186	7 183	11 077
VNI par action	\$ 8,89	\$ 9,14	\$ 10,91
Catégorie T :			
Capitalisation	€ 77 169	€ 83 511	€ 118 172
Actions émises en circulation	7 698	8 130	9 750
VNI par action	€ 10,02	€ 10,27	€ 12,12

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)			
Catégorie T en USD (couverte) :			
Capitalisation	\$ 3 426	\$ 3 396	\$ 618
Actions émises en circulation	407	399	63
VNI par action	\$ 8,42	\$ 8,51	\$ 9,83
Catégorie Z :			
Capitalisation	€ 125 444	€ 151 534	€ 192 397
Actions émises en circulation	11 817	14 087	15 504
VNI par action	€ 10,62	€ 10,76	€ 12,41
Fonds Emerging Local Bond Fund			
Actif net	\$ 2 785 443	\$ 1 918 352	\$ 2 151 129
Institutions :			
Capitalisation	\$ 1 606 951	\$ 1 294 872	\$ 1 416 960
Actions émises en circulation	116 296	102 499	104 910
VNI par action	\$ 13,82	\$ 12,63	\$ 13,51
Distribution	\$ 71 236	\$ 67 598	\$ 77 715
Actions émises en circulation	10 948	11 061	11 365
VNI par action	\$ 6,51	\$ 6,11	\$ 6,84
Institutions en CHF (non couverte) :			
Capitalisation	S/O	S/O	CHF 397
Actions émises en circulation	S/O	S/O	CHF 44
VNI par action	S/O	S/O	CHF 9,06
Institutions en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 394 731	€ 172 081	€ 250 076
Actions émises en circulation	28 260	13 181	19 088
VNI par action	€ 13,97	€ 13,06	€ 13,10
Distribution	€ 160 526	€ 132 910	€ 123 817
Actions émises en circulation	23 361	20 143	17 869
VNI par action	€ 6,87	€ 6,60	€ 6,93
Institutions en GBP (non couverte) :			
Capitalisation	£ 4 577	£ 3 789	£ 2 364
Actions émises en circulation	213	183	120
VNI par action	£ 21,47	£ 20,74	£ 19,70
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 6 492	\$ 19 062	\$ 38 617
Actions émises en circulation	624	2 001	3 779
VNI par action	\$ 10,40	\$ 9,53	\$ 10,22
Investisseurs en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 745	€ 698	€ 3 081
Actions émises en circulation	75	75	330
VNI par action	€ 9,90	€ 9,27	€ 9,33
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 50 073	\$ 35 711	\$ 39 398
Actions émises en circulation	4 185	3 249	3 319
VNI par action	\$ 11,96	\$ 10,99	\$ 11,87
Distribution	\$ 13 319	\$ 12 976	\$ 15 964
Actions émises en circulation	2 185	2 266	2 492
VNI par action	\$ 6,10	\$ 5,73	\$ 6,41
Catégorie E en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 80 099	€ 64 970	€ 77 057
Actions émises en circulation	5 303	4 579	5 359
VNI par action	€ 15,10	€ 14,19	€ 14,38
Distribution	€ 1 516	€ 1 509	€ 1 782
Actions émises en circulation	162	168	189
VNI par action	€ 9,33	€ 8,96	€ 9,41
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 307 491	\$ 48 177	\$ 10
Actions émises en circulation	31 625	5 416	1
VNI par action	\$ 9,72	\$ 8,90	\$ 9,52

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)			
Catégorie Z :			
Distribution	\$ 28 420	\$ 38 202	\$ 40 482
Actions émises en circulation	3 646	5 218	4 941
VNI par action	\$ 7,79	\$ 7,32	\$ 8,19
Fonds Emerging Local Bond ESG Fund			
Actif net	\$ 7 692	\$ 6 609	\$
Institutions :			
Capitalisation	\$ 5 662	\$ 5 169	S/O
Actions émises en circulation	489	489	S/O
VNI par action	\$ 11,58	\$ 10,57	S/O
Distribution	\$ 12	\$ 11	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	\$ 11,00	\$ 10,34	S/O
Institutions en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 409	€ 9	S/O
Actions émises en circulation	38	1	S/O
VNI par action	€ 10,74	€ 10,02	S/O
Distribution	€ 10	€ 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	€ 10,20	€ 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	£ 9,93	S/O	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 12	\$ 11	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	\$ 11,54	\$ 10,56	S/O
Distribution	\$ 12	\$ 11	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	\$ 11,00	\$ 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	€ 10,70	€ 10,01	S/O
Distribution	€ 10	€ 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	€ 10,20	€ 9,81	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 11	\$ 11	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	\$ 11,47	\$ 10,53	S/O
Distribution	\$ 11	\$ 11	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	\$ 11,00	\$ 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	€ 10,64	€ 9,98	S/O
Distribution	€ 10	€ 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	€ 10,20	€ 9,80	S/O
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 1 462	\$ 1 329	S/O
Actions émises en circulation	123	123	S/O
VNI par action	\$ 11,85	\$ 10,77	S/O

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Emerging Markets Bond Fund			
Actif net	\$ 3 389 647	\$ 3 305 979	\$ 4 714 744
Institutions :			
Capitalisation	\$ 1 133 970	\$ 1 097 175	\$ 1 578 727
Actions émises en circulation	24 102	24 303	28 997
VNI par action	\$ 47,05	\$ 45,15	\$ 54,45
Distribution	\$ 57 871	\$ 56 849	\$ 92 620
Actions émises en circulation	3 880	3 860	4 961
VNI par action	\$ 14,91	\$ 14,73	\$ 18,67
Institutions en CHF (couverte) :			
Distribution	CHF 74 259	CHF 77 505	CHF 97 681
Actions émises en circulation	5 209	5 390	5 215
VNI par action	CHF 14,26	CHF 14,38	CHF 18,73
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 708 917	€ 694 951	€ 695 028
Actions émises en circulation	19 469	19 643	15 897
VNI par action	€ 36,41	€ 35,38	€ 43,72
Distribution	€ 401 045	€ 401 157	€ 847 991
Actions émises en circulation	58 809	58 854	95 747
VNI par action	€ 6,82	€ 6,82	€ 8,86
Institutions en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 180 989	€ 135 251	€ 164 246
Actions émises en circulation	15 788	12 028	12 905
VNI par action	€ 11,46	€ 11,24	€ 12,73
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 20 148	£ 23 424	£ 26 418
Actions émises en circulation	827	997	922
VNI par action	£ 24,37	£ 23,50	£ 28,67
Distribution	£ 25 312	£ 28 487	£ 41 458
Actions émises en circulation	7 197	8 167	9 258
VNI par action	£ 3,52	£ 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 25 251	SGD 31 394	SGD 32 296
Actions émises en circulation	2 468	3 178	2 703
VNI par action	SGD 10,23	SGD 9,88	SGD 11,95
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 3 855	\$ 3 988	\$ 7 210
Actions émises en circulation	88	95	142
VNI par action	\$ 43,70	\$ 42,01	\$ 50,84
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 3 337	€ 3 248	€ 4 103
Actions émises en circulation	398	398	406
VNI par action	€ 8,38	€ 8,16	€ 10,11
Administrations :			
Capitalisation	\$ 24 780	\$ 22 981	\$ 34 503
Actions émises en circulation	581	560	693
VNI par action	\$ 42,69	\$ 41,06	\$ 49,77

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)			
BM Détail :			
Distribution II	\$ 354	\$ 9	S/O
Actions émises en circulation	39	1	S/O
VNI par action	\$ 9,10	\$ 9,11	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 111 695	\$ 114 186	\$ 165 453
Actions émises en circulation	2 765	2 933	3 492
VNI par action	\$ 40,39	\$ 38,93	\$ 47,38
Distribution	\$ 53 595	\$ 61 547	\$ 109 051
Actions émises en circulation	5 960	6 932	9 691
VNI par action	\$ 8,99	\$ 8,88	\$ 11,25
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 123 511	€ 125 229	€ 187 716
Actions émises en circulation	3 958	4 112	4 943
VNI par action	€ 31,21	€ 30,46	€ 37,98
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 10 517	SGD 10 020	SGD 11 604
Actions émises en circulation	185	181	172
VNI par action	SGD 56,96	SGD 55,23	SGD 67,40
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 264 425	\$ 302 479	\$ 284 247
Actions émises en circulation	5 773	6 875	5 348
VNI par action	\$ 45,81	\$ 44,00	\$ 53,15
Distribution	\$ 220	\$ 217	\$ 275
Actions émises en circulation	29	29	29
VNI par action	\$ 7,64	\$ 7,55	\$ 9,57
M Détail :			
Distribution	\$ 8 535	\$ 8 675	\$ 12 295
Actions émises en circulation	1 054	1 085	1 214
VNI par action	\$ 8,10	\$ 8,00	\$ 10,13
Distribution II	\$ 4 105	\$ 3 190	\$ 3 720
Actions émises en circulation	606	473	428
VNI par action	\$ 6,78	\$ 6,75	\$ 8,68
M Détail en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 2 087	AUD 1 510	AUD 7 264
Actions émises en circulation	288	209	784
VNI par action	AUD 7,24	AUD 7,22	AUD 9,27
Catégorie Z :			
Distribution	\$ 10 803	\$ 5 279	\$ 6 317
Actions émises en circulation	1 090	540	509
VNI par action	\$ 9,91	\$ 9,78	\$ 12,41
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund			
Actif net	\$ 2 372 964	\$ 2 492 475	\$ 2 635 769
Institutions :			
Capitalisation	\$ 663 705	\$ 640 128	\$ 650 604
Actions émises en circulation	44 995	45 303	37 005
VNI par action	\$ 14,75	\$ 14,13	\$ 17,58
Distribution	\$ 249 514	\$ 306 128	\$ 305 572
Actions émises en circulation	32 543	40 679	31 166
VNI par action	\$ 7,67	\$ 7,53	\$ 9,80

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)			
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 57 114	CHF 53 384	CHF 50 716
Actions émises en circulation	7 146	6 825	5 067
VNI par action	CHF 7,99	CHF 7,82	CHF 10,01
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 918 789	€ 1 011 465	€ 999 329
Actions émises en circulation	91 704	104 063	80 567
VNI par action	€ 10,02	€ 9,72	€ 12,40
Distribution	€ 161 385	€ 132 184	€ 192 797
Actions émises en circulation	24 171	19 921	21 737
VNI par action	€ 6,68	€ 6,64	€ 8,87
Institutions en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 111 994	£ 162 630	£ 80 974
Actions émises en circulation	15 259	22 478	8 479
VNI par action	£ 7,34	£ 7,24	£ 9,55
Institutions en GBP (non couverte) :			
Distribution	£ 4 817	£ 3 960	£ 3 657
Actions émises en circulation	629	499	398
VNI par action	£ 7,66	£ 7,94	£ 9,19
Investisseurs en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 5 387	NOK 5 222	NOK 6 610
Actions émises en circulation	50	50	50
VNI par action	NOK 107,24	NOK 103,95	NOK 131,59
Investisseurs en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 25 694	SEK 27 736	SEK 10 725
Actions émises en circulation	262	292	89
VNI par action	SEK 97,97	SEK 95,02	SEK 121,06
Administrations :			
Capitalisation	\$ 327	\$ 314	\$ 632
Actions émises en circulation	37	37	59
VNI par action	\$ 8,88	\$ 8,53	\$ 10,67
Distribution	\$ 732	\$ 718	\$ 992
Actions émises en circulation	95	95	101
VNI par action	\$ 7,67	\$ 7,53	\$ 9,81
Administrations en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 203	SEK 105	SEK 85
Actions émises en circulation	3	1	1
VNI par action	SEK 79,95	SEK 77,61	SEK 99,05
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 749	\$ 924	\$ 1 531
Actions émises en circulation	93	120	158
VNI par action	\$ 8,02	\$ 7,71	\$ 9,68
Distribution	\$ 542	\$ 676	\$ 868
Actions émises en circulation	74	94	92
VNI par action	\$ 7,36	\$ 7,23	\$ 9,41
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 55 074	€ 57 844	€ 129 837
Actions émises en circulation	6 328	6 822	11 895
VNI par action	€ 8,70	€ 8,48	€ 10,92
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 3 592	S/O	S/O
Actions émises en circulation	346	S/O	S/O
VNI par action	\$ 10,39	S/O	S/O
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund			
Actif net	\$ 159 733	\$ 168 986	\$ 212 894
Institutions :			
Capitalisation	\$ 10 965	\$ 8 279	\$ 9 507
Actions émises en circulation	696	535	532
VNI par action	\$ 15,76	\$ 15,48	\$ 17,88

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund (suite)			
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 92 098	€ 102 077	€ 113 058
Actions émises en circulation	7 070	7 881	7 392
VNI par action	€ 13,03	€ 12,95	€ 15,29
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 12 776	\$ 15 703	\$ 22 756
Actions émises en circulation	1 077	1 342	1 668
VNI par action	\$ 11,86	\$ 11,70	\$ 13,64
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 9 528	CHF 10 121	CHF 14 255
Actions émises en circulation	994	1 048	1 235
VNI par action	CHF 9,58	CHF 9,66	CHF 11,54
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 22 789	€ 23 540	€ 32 022
Actions émises en circulation	2 004	2 072	2 365
VNI par action	€ 11,38	€ 11,36	€ 13,54
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund			
Actif net	\$ 230 568	\$ 205 131	\$ 290 475
Institutions :			
Capitalisation	\$ 52 074	\$ 25 166	\$ 48 615
Actions émises en circulation	4 804	2 449	4 383
VNI par action	\$ 10,84	\$ 10,28	\$ 11,09
Institutions en EUR (partiellement couverte) :			
Capitalisation	€ 72 465	€ 72 560	€ 212 680
Actions émises en circulation	7 159	7 427	19 839
VNI par action	€ 10,12	€ 9,77	€ 10,72
Institutions en GBP (partiellement couverte) :			
Distribution	£ 783	£ 760	S/O
Actions émises en circulation	83	81	S/O
VNI par action	£ 9,44	£ 9,37	S/O
Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :			
Capitalisation	€ 9	€ 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	€ 9,68	€ 9,38	S/O
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 98 430	\$ 101 602	S/O
Actions émises en circulation	9 249	10 102	S/O
VNI par action	\$ 10,64	\$ 10,06	S/O
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund			
Actif net	\$ 20 083	\$ 20 937	\$ 29 760
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	€ 6 330	€ 6 154	€ 10 250
Actions émises en circulation	437	437	743
VNI par action	€ 14,49	€ 14,08	€ 13,80
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 4 147	\$ 4 388	\$ 5 195
Actions émises en circulation	335	371	417
VNI par action	\$ 12,40	\$ 11,84	\$ 12,47
Catégorie E en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 8 277	€ 9 351	€ 11 252
Actions émises en circulation	604	700	852
VNI par action	€ 13,68	€ 13,36	€ 13,20

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds PIMCO ESG Income Fund			
Actif net	\$ 254 692	\$ 237 961	\$ 125 087
Institutions :			
Capitalisation	\$ 46 808	\$ 23 414	\$ 5 465
Actions émises en circulation	4 897	2 486	541
VNI par action	\$ 9,56	\$ 9,42	\$ 10,10
Distribution	\$ 78	\$ 3 575	\$ 3 756
Actions émises en circulation	9	393	375
VNI par action	\$ 9,08	\$ 9,10	\$ 10,02
Institutions en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 67 951	AUD 57 036	AUD 14
Actions émises en circulation	7 637	6 338	1
VNI par action	AUD 8,90	AUD 9,00	AUD 10,00
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 2 353	CHF 7 316	CHF 692
Actions émises en circulation	260	803	69
VNI par action	CHF 9,05	CHF 9,11	CHF 10,02
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 87 068	€ 105 509	€ 72 025
Actions émises en circulation	9 472	11 509	7 175
VNI par action	€ 9,19	€ 9,17	€ 10,04
Distribution	€ 2 450	€ 1 925	€ 223
Actions émises en circulation	281	217	22
VNI par action	€ 8,72	€ 8,85	€ 9,95
Institutions en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 400	£ 405	£ 482
Actions émises en circulation	45	44	48
VNI par action	£ 8,94	£ 9,00	£ 9,98
Institutions en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 93 795	S/O	S/O
Actions émises en circulation	935	S/O	S/O
VNI par action	NOK 100,29	S/O	S/O
Institutions en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 142 648	SEK 122 486	SEK 77 208
Actions émises en circulation	1 549	1 335	772
VNI par action	SEK 92,08	SEK 91,73	SEK 99,96
Institutions en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 378	SGD 367	SGD 366
Actions émises en circulation	42	40	36
VNI par action	SGD 9,02	SGD 9,09	SGD 10,02
Administrations en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 94 159	SEK 79 369	S/O
Actions émises en circulation	967	816	S/O
VNI par action	SEK 97,34	SEK 97,22	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 2 136	\$ 1 433	\$ 285
Actions émises en circulation	228	155	28
VNI par action	\$ 9,38	\$ 9,28	\$ 10,04
Distribution	\$ 478	\$ 387	\$ 20
Actions émises en circulation	53	43	2
VNI par action	\$ 9,08	\$ 9,10	\$ 10,01
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Distribution	CHF 33	CHF 9	CHF 9
Actions émises en circulation	4	1	1
VNI par action	CHF 8,60	CHF 8,81	CHF 9,94
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 5 878	€ 4 811	€ 1 113
Actions émises en circulation	655	535	112
VNI par action	€ 8,98	€ 8,99	€ 9,94
Distribution	€ 1 640	€ 1 016	€ 256
Actions émises en circulation	188	115	26
VNI par action	€ 8,73	€ 8,86	€ 9,96

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)			
Catégorie R en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 29 989	AUD 31 770	AUD 29 726
Actions émises en circulation	3 370	3 530	2 973
VNI par action	AUD 8,90	AUD 9,00	AUD 10,00
Fonds Euro Bond Fund			
Actif net	€ 1 753 561	€ 1 913 275	€ 2 574 129
Institutions :			
Capitalisation	€ 1 249 288	€ 1 386 127	€ 1 926 406
Actions émises en circulation	56 667	64 252	73 731
VNI par action	€ 22,05	€ 21,57	€ 26,13
Distribution	€ 40 452	€ 68 589	€ 92 872
Actions émises en circulation	2 884	4 956	5 474
VNI par action	€ 14,02	€ 13,84	€ 16,97
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 311 440	CHF 313 292	CHF 351 467
Actions émises en circulation	10 434	10 631	9 789
VNI par action	CHF 29,85	CHF 29,47	CHF 35,91
Investisseurs :			
Capitalisation	€ 17 505	€ 16 885	€ 23 320
Actions émises en circulation	854	841	956
VNI par action	€ 20,49	€ 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	€ 104 052	€ 101 050	€ 151 006
Actions émises en circulation	5 517	5 451	6 666
VNI par action	€ 18,86	€ 18,54	€ 22,65
Distribution	€ 23 186	€ 23 340	€ 38 508
Actions émises en circulation	2 291	2 337	3 146
VNI par action	€ 10,12	€ 9,99	€ 12,24
Fonds Euro Credit Fund			
Actif net	€ 609 939	€ 610 008	€ 1 017 163
Institutions :			
Capitalisation	€ 321 840	€ 348 784	€ 743 335
Actions émises en circulation	21 969	24 516	43 513
VNI par action	€ 14,65	€ 14,23	€ 17,08
Distribution II	€ 13 728	€ 16 940	€ 80 562
Actions émises en circulation	1 499	1 879	7 303
VNI par action	€ 9,16	€ 9,02	€ 11,03
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 39 190	€ 11 194	€ 18 325
Actions émises en circulation	3 420	1 001	1 353
VNI par action	€ 11,46	€ 11,18	€ 13,54

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Euro Credit Fund (suite)			
H Institutions :			
Capitalisation	€ 235 086	€ 232 926	€ 173 091
Actions émises en circulation	26 606	27 156	16 823
VNI par action	€ 8,84	€ 8,58	€ 10,29
Distribution II	€ 95	€ 164	€ 1 850
Actions émises en circulation	11	20	186
VNI par action	€ 8,28	€ 8,14	€ 9,93
Fonds Euro Income Bond Fund			
Actif net	€ 1 262 170	€ 1 352 980	€ 2 482 304
Institutions :			
Capitalisation	€ 268 786	€ 332 727	€ 895 043
Actions émises en circulation	18 780	23 944	56 691
VNI par action	€ 14,31	€ 13,90	€ 15,79
Distribution	€ 63 189	€ 79 523	€ 128 548
Actions émises en circulation	6 688	8 533	11 833
VNI par action	€ 9,45	€ 9,32	€ 10,86
Investisseurs :			
Capitalisation	€ 11 955	€ 10 138	€ 14 129
Actions émises en circulation	1 302	1 136	1 388
VNI par action	€ 9,18	€ 8,93	€ 10,18
Distribution	€ 7 961	€ 8 520	€ 10 907
Actions émises en circulation	867	939	1 027
VNI par action	€ 9,19	€ 9,08	€ 10,62
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 532 110	€ 540 713	€ 856 874
Actions émises en circulation	41 541	43 285	59 839
VNI par action	€ 12,81	€ 12,49	€ 14,32
Distribution	€ 344 813	€ 347 514	€ 527 452
Actions émises en circulation	41 063	41 763	53 871
VNI par action	€ 8,40	€ 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	€ 24 126	€ 24 746	€ 32 571
Actions émises en circulation	2 452	2 573	2 943
VNI par action	€ 9,84	€ 9,62	€ 11,07
Distribution	€ 9 230	€ 9 099	€ 12 914
Actions émises en circulation	1 242	1 234	1 482
VNI par action	€ 7,43	€ 7,38	€ 8,72
Fonds Euro Long Average Duration Fund			
Actif net	€ 449 965	€ 110 048	€ 160 601
Institutions :			
Capitalisation	€ 449 965	€ 110 048	€ 160 601
Actions émises en circulation	22 644	5 786	5 426
VNI par action	€ 19,87	€ 19,02	€ 29,60
Fonds Euro Short-Term Fund			
Actif net	€ 213 359	€ 353 095	€ 629 859
Institutions :			
Capitalisation	€ 199 267	€ 339 031	€ 616 693
Actions émises en circulation	16 588	28 689	51 558
VNI par action	€ 12,01	€ 11,82	€ 11,96
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 14 092	€ 14 064	€ 13 166
Actions émises en circulation	1 335	1 350	1 239
VNI par action	€ 10,55	€ 10,42	€ 10,63

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund		
Actif net	€ 224 673	€ 174 162	€ 170 489
Institutions :			
Capitalisation	€ 113 197	€ 32 875	12 500
Actions émises en circulation	11 107	3 379	1 159
VNI par action	€ 10,19	€ 9,73	10,79
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 807	10	S/O
Actions émises en circulation	77	1	S/O
VNI par action	€ 10,42	10,00	S/O
Distribution	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 10,04	S/O	S/O
Catégorie Z :			
Capitalisation	€ 110 660	€ 141 277	157 989
Actions émises en circulation	10 663	14 301	14 501
VNI par action	€ 10,38	€ 9,88	10,90
	Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Actif net	€ 147 878	€ 211 172	395 491
Institutions :			
Capitalisation	€ 79 010	€ 127 942	254 925
Actions émises en circulation	7 148	11 637	22 466
VNI par action	€ 11,05	€ 10,99	11,35
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 9 635	€ 7 775	4 368
Actions émises en circulation	1 020	826	447
VNI par action	€ 9,45	€ 9,42	9,77
H Institutions :			
Capitalisation	€ 59 233	€ 75 455	136 198
Actions émises en circulation	6 179	7 907	13 806
VNI par action	€ 9,59	€ 9,54	9,87
	Fonds Global Advantage Fund		
Actif net	\$ 411 615	\$ 410 459	521 067
Institutions :			
Capitalisation	\$ 8 132	\$ 7 716	24 968
Actions émises en circulation	601	582	1 630
VNI par action	\$ 13,52	\$ 13,28	15,32
Institutions en CHF (partiellement couverte) :			
Distribution	CHF 108 436	CHF 111 046	CHF 132 681
Actions émises en circulation	12 443	12 487	12 823
VNI par action	CHF 8,71	CHF 8,89	10,35
Institutions en EUR (partiellement couverte) :			
Capitalisation	€ 201 137	€ 203 446	237 602
Actions émises en circulation	15 529	15 828	16 656
VNI par action	€ 12,95	€ 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 600 953	NOK 577 381	625 501
Actions émises en circulation	4 103	4 099	4 093
VNI par action	NOK 146,48	NOK 140,84	152,81
Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :			
Capitalisation	€ 6 182	€ 6 540	8 002
Actions émises en circulation	543	576	629
VNI par action	€ 11,39	€ 11,36	12,73

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
	Fonds Global Bond Fund		
Actif net	\$ 12 611 710	\$ 11 420 112	\$ 14 038 846
Institutions :			
Capitalisation	\$ 3 966 129	\$ 3 410 090	\$ 3 999 850
Actions émises en circulation	121 631	107 593	111 904
VNI par action	\$ 32,61	\$ 31,69	\$ 35,74
Distribution	\$ 200 181	\$ 172 513	\$ 203 191
Actions émises en circulation	11 278	9 898	10 136
VNI par action	\$ 17,75	\$ 17,43	\$ 20,05
Institutions (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	\$ 435 322	\$ 326 665	\$ 328 710
Actions émises en circulation	14 802	11 261	9 512
VNI par action	\$ 29,41	\$ 29,01	\$ 34,56
Distribution	\$ 19 508	\$ 19 875	\$ 26 341
Actions émises en circulation	1 056	1 080	1 178
VNI par action	\$ 18,47	\$ 18,41	\$ 22,37
Institutions en CAD (couverte) :			
Capitalisation	CAD 53 605	CAD 54 563	CAD 72 089
Actions émises en circulation	5 169	5 395	6 309
VNI par action	CAD 10,37	CAD 10,11	CAD 11,43
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 408 918	CHF 440 925	CHF 552 547
Actions émises en circulation	13 541	14 706	15 928
VNI par action	CHF 30,20	CHF 29,98	CHF 34,69
Distribution	CHF 141 629	CHF 175 781	CHF 218 701
Actions émises en circulation	8 158	10 095	10 645
VNI par action	CHF 17,36	CHF 17,41	CHF 20,54
Institutions en EUR (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	€ 221 278	€ 190 480	€ 139 337
Actions émises en circulation	17 347	14 810	9 692
VNI par action	€ 12,76	€ 12,86	€ 14,38
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 2 003 719	€ 1 974 600	€ 2 453 258
Actions émises en circulation	78 173	78 287	84 453
VNI par action	€ 25,63	€ 25,22	€ 29,05
Distribution	€ 654 475	€ 512 652	€ 628 774
Actions émises en circulation	41 060	32 355	33 781
VNI par action	€ 15,94	€ 15,84	€ 18,61
Institutions en GBP (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	£ 3 398	£ 3 343	£ 3 600
Actions émises en circulation	332	313	319
VNI par action	£ 10,24	£ 10,68	£ 11,30
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 152 551	£ 162 896	£ 198 000
Actions émises en circulation	7 207	7 879	8 429
VNI par action	£ 21,17	£ 20,68	£ 23,49
Distribution	£ 124 770	£ 132 242	£ 191 729
Actions émises en circulation	10 180	10 904	13 574
VNI par action	£ 12,26	£ 12,13	£ 14,13

	Au 30 juin 2023		Au 31 déc. 2022		Au 31 déc. 2021	
	Fonds Global Bond Fund (suite)					
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	2 304 436	NOK	2 918 045	NOK	4 130 842
Actions émises en circulation		11 023		14 215		17 688
VNI par action	NOK	209,05	NOK	205,28	NOK	233,55
Institutions en NZD (couverte) :						
Distribution	NZD	171 963	NZD	167 929	NZD	309 397
Actions émises en circulation		4 194		4 162		6 643
VNI par action	NZD	41,00	NZD	40,35	NZD	46,57
Institutions en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	1 153 251	SEK	1 120 588	SEK	1 219 998
Actions émises en circulation		5 778		5 712		5 426
VNI par action	SEK	199,58	SEK	196,17	SEK	224,86
Institutions en SGD (couverte) :						
Capitalisation	SGD	250 973	SGD	217 237	SGD	174 944
Actions émises en circulation		14 307		12 665		9 030
VNI par action	SGD	17,54	SGD	17,15	SGD	19,37
Distribution	SGD	17		S/O		S/O
Actions émises en circulation		2		S/O		S/O
VNI par action	SGD	10,03		S/O		S/O
Investisseurs :						
Capitalisation	\$	194 564	\$	94 643	\$	135 136
Actions émises en circulation		6 492		3 244		4 092
VNI par action	\$	29,97	\$	29,18	\$	33,02
Distribution	\$	51 329	\$	28 517	\$	7 773
Actions émises en circulation		3 442		1 948		462
VNI par action	\$	14,91	\$	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	137 926	CHF	145 814	CHF	188 770
Actions émises en circulation		11 893		12 641		14 095
VNI par action	CHF	11,60	CHF	11,53	CHF	13,39
Investisseurs en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	78 996	€	75 495	€	92 541
Actions émises en circulation		3 289		3 189		3 382
VNI par action	€	24,02	€	23,68	€	27,36
Investisseurs en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£	6 531	£	5 437	£	5 846
Actions émises en circulation		329		280		264
VNI par action	£	19,88	£	19,45	£	22,17
Investisseurs en NOK (couverte) :						
Capitalisation	NOK	44 393	NOK	23 662	NOK	28 765
Actions émises en circulation		225		122		130
VNI par action	NOK	196,93	NOK	193,71	NOK	221,16

	Au 30 juin 2023		Au 31 déc. 2022		Au 31 déc. 2021	
	Fonds Global Bond Fund (suite)					
Administrations :						
Capitalisation	\$	11 114	\$	9 565	\$	15 922
Actions émises en circulation		382		337		495
VNI par action	\$	29,12	\$	28,38	\$	32,16
Administrations en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	143 527	SEK	114 069	SEK	1 941
Actions émises en circulation		1 643		1 325		20
VNI par action	SEK	87,36	SEK	86,08	SEK	99,17
Catégorie E :						
Capitalisation	\$	364 774	\$	326 703	\$	463 700
Actions émises en circulation		13 087		12 006		14 974
VNI par action	\$	27,87	\$	27,21	\$	30,97
Distribution	\$	154 008	\$	101 393	\$	117 421
Actions émises en circulation		12 012		8 054		8 111
VNI par action	\$	12,82	\$	12,59	\$	14,48
Catégorie E (exposition au risque de change) :						
Capitalisation	\$	41 771	\$	34 705	\$	61 145
Actions émises en circulation		3 570		2 994		4 389
VNI par action	\$	11,70	\$	11,59	\$	13,93
Distribution	\$	20 543	\$	13 040	\$	16 440
Actions émises en circulation		2 078		1 324		1 374
VNI par action	\$	9,89	\$	9,85	\$	11,97
Catégorie E en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	3 008	CHF	1 921	CHF	2 358
Actions émises en circulation		336		215		226
VNI par action	CHF	8,94	CHF	8,92	CHF	10,41
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	713 262	€	685 427	€	959 543
Actions émises en circulation		32 545		31 641		38 117
VNI par action	€	21,92	€	21,66	€	25,17
Distribution	€	38 410	€	31 423	€	41 846
Actions émises en circulation		4 390		3 613		4 097
VNI par action	€	8,75	€	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	€	63 243	€	66 161	€	123 034
Actions émises en circulation		7 127		7 543		11 955
VNI par action	€	8,87	€	8,77	€	10,29
H Institutions :						
Capitalisation	\$	881 595	\$	752 379	\$	835 136
Actions émises en circulation		27 984		24 551		24 124
VNI par action	\$	31,50	\$	30,65	\$	34,62
Distribution	\$	2 143	\$	2 035	\$	2 643
Actions émises en circulation		239		231		261
VNI par action	\$	8,95	\$	8,79	\$	10,11
H Institutions (exposition au risque de change) :						
Capitalisation	\$	66 028	\$	309 569	\$	756
Actions émises en circulation		7 975		37 885		78
VNI par action	\$	8,28	\$	8,17	\$	9,75
M Détail :						
Distribution II	\$	1 554	\$	1 358	\$	1 742
Actions émises en circulation		173		153		168
VNI par action	\$	8,99	\$	8,89	\$	10,34
M Détail en HKD (non couverte) :						
Distribution II	HKD	13 199	HKD	5 118	HKD	8 307
Actions émises en circulation		1 459		575		802
VNI par action	HKD	9,05	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

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Global Bond Fund (suite)			
M Détail en SGD (couverte) :			
Distribution II	SGD 8 238	S/O	S/O
Actions émises en circulation	825	S/O	S/O
VNI par action	SGD 9,98	S/O	S/O
Catégorie R en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 6 030	€ 5 591	€ 6 442
Actions émises en circulation	563	530	528
VNI par action	€ 10,71	€ 10,56	€ 12,19
Catégorie T :			
Capitalisation	\$ 16 756	\$ 15 814	\$ 26 245
Actions émises en circulation	1 541	1 487	2 163
VNI par action	\$ 10,87	\$ 10,63	\$ 12,14
Distribution	\$ 3 056	\$ 3 040	\$ 4 183
Actions émises en circulation	299	303	362
VNI par action	\$ 10,22	\$ 10,04	\$ 11,54
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 19 604	€ 14 560	€ 19 104
Actions émises en circulation	2 088	1 567	1 764
VNI par action	€ 9,39	€ 9,29	€ 10,83
Catégorie W :			
Capitalisation	\$ 87 738	\$ 24 415	\$ 29 951
Actions émises en circulation	9 498	2 721	2 962
VNI par action	\$ 9,24	\$ 8,97	\$ 10,11
Distribution	\$ 44 217	\$ 9 498	\$ 9 066
Actions émises en circulation	5 057	1 106	919
VNI par action	\$ 8,74	\$ 8,59	\$ 9,87
Distribution II	\$ 10	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	\$ 10,06	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 27 948	CHF 24 828	CHF 33 361
Actions émises en circulation	3 222	2 884	3 352
VNI par action	CHF 8,68	CHF 8,61	CHF 9,95
Distribution	CHF 2 888	CHF 705	CHF 740
Actions émises en circulation	352	86	76
VNI par action	CHF 8,21	CHF 8,24	CHF 9,72
Catégorie W en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 16 592	€ 9 594	€ 14 976
Actions émises en circulation	1 881	1 106	1 500
VNI par action	€ 8,82	€ 8,68	€ 9,98
Distribution	€ 3 775	€ 2 352	€ 2 251
Actions émises en circulation	452	283	231
VNI par action	€ 8,35	€ 8,30	€ 9,75
Catégorie W en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 10 991	£ 2 383	£ 1 265
Actions émises en circulation	1 209	268	126
VNI par action	£ 9,09	£ 8,88	£ 10,08
Distribution	£ 8 358	£ 5 877	£ 9 060
Actions émises en circulation	971	692	921
VNI par action	£ 8,61	£ 8,49	£ 9,84
Catégorie W en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 6 347	NOK 4 083	NOK 3 799
Actions émises en circulation	71	46	38
VNI par action	NOK 90,02	NOK 88,35	NOK 100,41

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Global Bond Fund (suite)			
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 8 489	S/O	S/O
Actions émises en circulation	847	S/O	S/O
VNI par action	SGD 10,02	S/O	S/O
Fonds Global Bond ESG Fund			
Actif net	\$ 3 344 834	\$ 3 106 190	\$ 2 302 966
Institutions :			
Capitalisation	\$ 306 549	\$ 366 227	\$ 300 944
Actions émises en circulation	28 199	34 584	25 077
VNI par action	\$ 10,87	\$ 10,59	\$ 12,00
Distribution	\$ 48 694	\$ 65 549	\$ 25 309
Actions émises en circulation	5 270	7 213	2 428
VNI par action	\$ 9,24	\$ 9,09	\$ 10,43
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 586 386	CHF 454 679	CHF 22 579
Actions émises en circulation	63 579	49 550	2 115
VNI par action	CHF 9,22	CHF 9,18	CHF 10,67
Institutions en EUR (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	€ 753	€ 3 933	€ 856
Actions émises en circulation	86	444	86
VNI par action	€ 8,76	€ 8,85	€ 9,96
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 866 995	€ 957 548	€ 623 870
Actions émises en circulation	91 026	101 940	57 390
VNI par action	€ 9,52	€ 9,39	€ 10,87
Distribution	€ 68 746	€ 92 352	€ 111 407
Actions émises en circulation	7 928	10 695	11 012
VNI par action	€ 8,67	€ 8,63	€ 10,12
Institutions en GBP (exposition au risque de change) :			
Distribution	£ 8	£ 8	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	£ 9,03	£ 9,55	S/O
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 2 345	£ 2 394	£ 16 849
Actions émises en circulation	254	266	1 634
VNI par action	£ 9,22	£ 9,03	£ 10,31
Distribution	£ 280 534	£ 84 397	£ 75 165
Actions émises en circulation	30 396	9 242	7 117
VNI par action	£ 9,23	£ 9,13	£ 10,56
Institutions en GBP (non couverte) :			
Distribution	£ 23 988	£ 20 996	£ 23 387
Actions émises en circulation	2 664	2 240	2 448
VNI par action	£ 9,01	£ 9,37	£ 9,55
Institutions en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 5 924 379	NOK 5 366 868	NOK 5 205 593
Actions émises en circulation	576 649	531 175	450 696
VNI par action	NOK 10,27	NOK 10,10	NOK 11,55

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Global Bond ESG Fund (suite)			
Institutions en NZD (couverte) :			
Distribution	NZD 66 272	NZD 64 722	NZD 74 299
Actions émises en circulation	6 817	6 755	6 732
VNI par action	NZD 9,72	NZD 9,58	NZD 11,04
Institutions en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 149 958	SEK 504 943	SEK 568 764
Actions émises en circulation	1 699	5 807	5 678
VNI par action	SEK 88,28	SEK 86,95	SEK 100,17
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 11 112	\$ 8 195	\$ 12 127
Actions émises en circulation	1 073	811	1 055
VNI par action	\$ 10,35	\$ 10,10	\$ 11,49
Administrations :			
Capitalisation	S/O	S/O	\$ 2 318
Actions émises en circulation	S/O	S/O	208
VNI par action	S/O	S/O	\$ 11,12
Distribution	S/O	S/O	\$ 11
Actions émises en circulation	S/O	S/O	1
VNI par action	S/O	S/O	\$ 10,82
Administrations en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 103	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	SEK 99,81	S/O	S/O
Catégorie E :			
Distribution	\$ 4 262	\$ 3 846	\$ 2 115
Actions émises en circulation	445	408	196
VNI par action	\$ 9,58	\$ 9,42	\$ 10,81
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 750	CHF 77	S/O
Actions émises en circulation	78	8	S/O
VNI par action	CHF 9,67	CHF 9,66	S/O
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 41 034	€ 38 263	€ 48 847
Actions émises en circulation	4 556	4 288	4 688
VNI par action	€ 9,01	€ 8,92	€ 10,42
Catégorie Z en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 381 343	AUD 356 037	AUD 250 833
Actions émises en circulation	39 825	37 495	22 777
VNI par action	AUD 9,58	AUD 9,50	AUD 11,01
Fonds Global Bond Ex-US Fund			
Actif net	\$ 730 576	\$ 716 022	\$ 911 707
Institutions :			
Capitalisation	\$ 431 110	\$ 420 156	\$ 527 915
Actions émises en circulation	18 628	18 790	21 249
VNI par action	\$ 23,14	\$ 22,36	\$ 24,84
Distribution	\$ 33 473	\$ 32 820	\$ 52 506
Actions émises en circulation	2 200	2 206	3 117
VNI par action	\$ 15,21	\$ 14,88	\$ 16,85
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 22 664	€ 45 032	€ 23 841
Actions émises en circulation	1 385	2 816	1 315
VNI par action	€ 16,37	€ 15,99	€ 18,13
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 6 695	\$ 6 657	\$ 17 194
Actions émises en circulation	308	316	732
VNI par action	\$ 21,77	\$ 21,07	\$ 23,49
Administrations :			
Capitalisation	\$ 10 266	\$ 10 720	\$ 12 451
Actions émises en circulation	487	525	546
VNI par action	\$ 21,07	\$ 20,41	\$ 22,79

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)			
Catégorie E :			
Distribution	\$ 48 103	\$ 23 336	\$ 54 115
Actions émises en circulation	3 255	1 615	3 309
VNI par action	\$ 14,78	\$ 14,45	\$ 16,36
Catégorie E (exposition au risque de change) :			
Distribution	\$ 57 147	\$ 62 837	\$ 81 361
Actions émises en circulation	7 182	7 858	8 142
VNI par action	\$ 7,96	\$ 8,00	\$ 9,99
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 10 405	\$ 6 714	\$ 1 160
Actions émises en circulation	1 000	667	104
VNI par action	\$ 10,40	\$ 10,06	\$ 11,20
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 108 652	\$ 104 722	\$ 137 893
Actions émises en circulation	10 957	10 957	13 049
VNI par action	\$ 9,92	\$ 9,56	\$ 10,57
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund			
Actif net	\$ 668 587	\$ 750 076	\$ 1 035 021
Institutions :			
Capitalisation	\$ 29 697	\$ 30 140	\$ 37 389
Actions émises en circulation	1 416	1 526	1 571
VNI par action	\$ 20,97	\$ 19,74	\$ 23,80
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 163 646	€ 204 979	€ 352 099
Actions émises en circulation	8 827	11 632	16 474
VNI par action	€ 18,54	€ 17,62	€ 21,37
Institutions en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 3 185	£ 3 301	£ 4 301
Actions émises en circulation	307	331	345
VNI par action	£ 10,38	£ 9,99	£ 12,45
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 10 783	\$ 10 303	\$ 10 116
Actions émises en circulation	695	704	571
VNI par action	\$ 15,52	\$ 14,63	\$ 17,70
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 31 973	\$ 32 627	\$ 40 303
Actions émises en circulation	1 802	1 942	1 966
VNI par action	\$ 17,74	\$ 16,80	\$ 20,50
Distribution	\$ 12 324	\$ 13 011	\$ 13 372
Actions émises en circulation	1 325	1 448	1 172
VNI par action	\$ 9,30	\$ 8,98	\$ 11,41
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 219 668	€ 217 239	€ 230 733
Actions émises en circulation	14 015	14 494	12 541
VNI par action	€ 15,67	€ 14,99	€ 18,40
Distribution	€ 49 132	€ 49 389	€ 57 708
Actions émises en circulation	5 891	6 071	5 551
VNI par action	€ 8,34	€ 8,14	€ 10,40
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 10	\$ 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	\$ 10,01	\$ 9,43	S/O
Distribution	\$ 10	\$ 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	\$ 9,55	\$ 9,18	S/O
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 107 942	\$ 156 684	\$ 199 594
Actions émises en circulation	6 871	10 644	11 355
VNI par action	\$ 15,71	\$ 14,72	\$ 17,58

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Fonds Global High Yield Bond Fund		
	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Actif net	\$ 3 069 836	\$ 3 102 868	\$ 5 169 160
Institutions :			
Capitalisation	\$ 603 637	\$ 579 939	\$ 844 967
Actions émises en circulation	22 235	22 368	29 240
VNI par action	\$ 27,15	\$ 25,93	\$ 28,90
Distribution	\$ 292 557	\$ 292 202	\$ 489 734
Actions émises en circulation	29 353	29 927	42 937
VNI par action	\$ 9,97	\$ 9,76	\$ 11,41
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 23 368	CHF 22 915	CHF 38 082
Actions émises en circulation	1 431	1 439	2 089
VNI par action	CHF 16,33	CHF 15,92	CHF 18,23
Distribution	CHF 2 775	CHF 3 237	CHF 16 630
Actions émises en circulation	374	436	1 863
VNI par action	CHF 7,42	CHF 7,43	CHF 8,93
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 697 933	€ 725 182	€ 1 232 938
Actions émises en circulation	30 367	32 640	48 671
VNI par action	€ 22,98	€ 22,22	€ 25,33
Distribution	€ 130 874	€ 155 150	€ 119 724
Actions émises en circulation	13 258	15 853	10 243
VNI par action	€ 9,87	€ 9,79	€ 11,69
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 37 494	£ 31 335	£ 239 206
Actions émises en circulation	2 446	2 130	14 437
VNI par action	£ 15,33	£ 14,71	£ 16,57
Distribution	£ 277 935	£ 292 800	£ 557 487
Actions émises en circulation	55 590	59 445	95 775
VNI par action	£ 5,00	£ 4,93	£ 5,82
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 1 609	\$ 1 820	\$ 12 295
Actions émises en circulation	126	149	902
VNI par action	\$ 12,74	\$ 12,19	\$ 13,64
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 5 598	€ 12 416	€ 5 703
Actions émises en circulation	255	583	234
VNI par action	€ 21,99	€ 21,30	€ 24,37
Administrations :			
Capitalisation	\$ 31 001	\$ 30 795	\$ 50 855
Actions émises en circulation	1 230	1 276	1 881
VNI par action	\$ 25,21	\$ 24,14	\$ 27,04
Distribution	\$ 16 535	\$ 21 259	\$ 32 985
Actions émises en circulation	1 695	2 225	2 956
VNI par action	\$ 9,76	\$ 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

	Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)		
	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
BM Détail :			
Distribution II	\$ 698	\$ 10	S/O
Actions émises en circulation	74	1	S/O
VNI par action	\$ 9,42	\$ 9,34	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 132 190	\$ 129 353	\$ 186 558
Actions émises en circulation	5 662	5 776	7 407
VNI par action	\$ 23,35	\$ 22,40	\$ 25,19
Distribution	\$ 93 498	\$ 109 532	\$ 151 015
Actions émises en circulation	9 523	11 389	13 453
VNI par action	\$ 9,82	\$ 9,62	\$ 11,23
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 228 096	€ 224 727	€ 299 451
Actions émises en circulation	10 274	10 424	12 074
VNI par action	€ 22,20	€ 21,56	€ 24,80
Distribution	€ 27 189	€ 27 782	€ 38 159
Actions émises en circulation	3 369	3 472	3 992
VNI par action	€ 8,07	€ 8,00	€ 9,56
Catégorie E en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 4 859	£ 5 932	£ 7 285
Actions émises en circulation	461	572	595
VNI par action	£ 10,55	£ 10,38	£ 12,25
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 7 490	SGD 6 387	SGD 11 731
Actions émises en circulation	822	711	1 116
VNI par action	SGD 9,11	SGD 8,98	SGD 10,52
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 192 953	\$ 218 500	\$ 82 082
Actions émises en circulation	7 403	8 771	2 952
VNI par action	\$ 26,07	\$ 24,91	\$ 27,81
Distribution	\$ 14 121	\$ 4 003	\$ 10 759
Actions émises en circulation	1 598	462	1 064
VNI par action	\$ 8,84	\$ 8,66	\$ 10,11
M Détail :			
Distribution	\$ 17 428	\$ 17 710	\$ 25 552
Actions émises en circulation	1 798	1 865	2 306
VNI par action	\$ 9,69	\$ 9,50	\$ 11,08
Distribution II	\$ 32 785	\$ 35 654	\$ 107 627
Actions émises en circulation	4 221	4 652	11 857
VNI par action	\$ 7,77	\$ 7,66	\$ 9,08
Catégorie R :			
Capitalisation	\$ 2 607	\$ 2 617	\$ 73 221
Actions émises en circulation	175	184	4 598
VNI par action	\$ 14,90	\$ 14,25	\$ 15,92
Catégorie T :			
Capitalisation	\$ 5 577	\$ 5 339	\$ 7 458
Actions émises en circulation	449	448	554
VNI par action	\$ 12,41	\$ 11,93	\$ 13,47
Distribution	\$ 1 833	\$ 1 796	\$ 2 373
Actions émises en circulation	200	200	227
VNI par action	\$ 9,15	\$ 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

Actif net	Fonds Global Investment Grade Credit Fund		
	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Institutions :			
Capitalisation	\$ 2 487 175	\$ 2 618 560	\$ 3 806 107
Actions émises en circulation	129 215	140 682	172 781
VNI par action	\$ 19,25	\$ 18,61	\$ 22,03
Distribution	\$ 532 043	\$ 474 941	\$ 705 907
Actions émises en circulation	48 764	44 276	53 902
VNI par action	\$ 10,91	\$ 10,73	\$ 13,10
Institutions (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	\$ 105 945	\$ 100 855	\$ 86 823
Actions émises en circulation	7 520	7 439	5 244
VNI par action	\$ 14,09	\$ 13,56	\$ 16,56
Distribution	\$ 21 149	\$ 22 435	\$ 33 395
Actions émises en circulation	2 613	2 833	3 347
VNI par action	\$ 8,09	\$ 7,92	\$ 9,98
Institutions en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 6 755	AUD 7 370	AUD 90 155
Actions émises en circulation	783	861	8 528
VNI par action	AUD 8,63	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 545 661	CHF 656 465	CHF 814 188
Actions émises en circulation	36 427	44 353	45 260
VNI par action	CHF 14,98	CHF 14,80	CHF 17,99
Distribution	CHF 32 601	CHF 33 474	CHF 49 517
Actions émises en circulation	4 572	4 674	5 516
VNI par action	CHF 7,13	CHF 7,16	CHF 8,98
Institutions en CZK (couverte) :			
Distribution	CZK 246 708	CZK 339 010	CZK 2 085 033
Actions émises en circulation	29 448	41 499	216 797
VNI par action	CZK 8,38	CZK 8,17	CZK 9,62
Institutions en EUR (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	€ 47 121	€ 43 714	€ 39 844
Actions émises en circulation	3 649	3 441	2 737
VNI par action	€ 12,91	€ 12,70	€ 14,56
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 1 105 573	€ 1 343 974	€ 2 237 224
Actions émises en circulation	64 414	79 965	109 970
VNI par action	€ 17,16	€ 16,81	€ 20,34
Distribution	€ 420 978	€ 447 965	€ 803 485
Actions émises en circulation	44 462	47 525	68 258
VNI par action	€ 9,47	€ 9,43	€ 11,77
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 164 090	£ 112 550	£ 258 867
Actions émises en circulation	8 522	6 014	11 576
VNI par action	£ 19,26	£ 18,72	£ 22,36

	Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)		
	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Distribution	£ 774 234	£ 767 395	£ 1 684 722
Actions émises en circulation	69 315	69 403	123 537
VNI par action	£ 11,17	£ 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 262 868	NOK 258 128	NOK 429 061
Actions émises en circulation	1 921	1 931	2 683
VNI par action	NOK 136,86	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 2 720 008	SEK 2 527 557	SEK 3 657 935
Actions émises en circulation	185 349	176 118	211 649
VNI par action	SEK 14,68	SEK 14,35	SEK 17,28
Institutions en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 54 868	SGD 11 301	SGD 8 028
Actions émises en circulation	6 201	1 291	749
VNI par action	SGD 8,85	SGD 8,76	SGD 10,72
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 362 677	\$ 440 714	\$ 988 957
Actions émises en circulation	17 322	21 729	41 056
VNI par action	\$ 20,94	\$ 20,28	\$ 24,09
Distribution	\$ 143 514	\$ 131 169	\$ 92 275
Actions émises en circulation	12 360	11 489	6 624
VNI par action	\$ 11,61	\$ 11,42	\$ 13,93
Investisseurs en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 8 279	AUD 10 542	AUD 5 854
Actions émises en circulation	978	1 256	565
VNI par action	AUD 8,46	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
Investisseurs en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 4 990	CHF 5 359	CHF 7 624
Actions émises en circulation	456	494	577
VNI par action	CHF 10,95	CHF 10,84	CHF 13,22
Distribution	CHF 4 101	CHF 5 334	CHF 8 176
Actions émises en circulation	447	578	707
VNI par action	CHF 9,18	CHF 9,23	CHF 11,56
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 24 702	€ 26 086	€ 49 619
Actions émises en circulation	1 529	1 646	2 577
VNI par action	€ 16,16	€ 15,85	€ 19,25

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023		Au 31 déc. 2022		Au 31 déc. 2021	
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)					
Distribution	€	10 682	€	11 379	€	16 646
Actions émises en circulation		1 076		1 151		1 349
VNI par action	€	9,93	€	9,88	€	12,34
Investisseurs en GBP (couverte) :						
Distribution	£	4 161	£	4 175	£	5 735
Actions émises en circulation		383		389		433
VNI par action	£	10,86	£	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	8 454	SGD	7 277	SGD	7 473
Actions émises en circulation		979		852		715
VNI par action	SGD	8,63	SGD	8,54	SGD	10,45
Administrations :						
Capitalisation	\$	78 873	\$	76 931	\$	215 743
Actions émises en circulation		4 404		4 431		10 444
VNI par action	\$	17,91	\$	17,36	\$	20,66
Distribution	\$	72 099	\$	47 290	\$	99 369
Actions émises en circulation		6 424		4 285		7 378
VNI par action	\$	11,22	\$	11,04	\$	13,47
Administrations en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	168	CHF	391	CHF	629
Actions émises en circulation		17		41		54
VNI par action	CHF	9,63	CHF	9,54	CHF	11,65
Administrations en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	11 659	€	7 522	€	9 518
Actions émises en circulation		765		503		523
VNI par action	€	15,25	€	14,97	€	18,21
Distribution	€	8 889	€	7 846	€	9 315
Actions émises en circulation		927		822		782
VNI par action	€	9,59	€	9,54	€	11,91
Administrations en GBP (couverte) :						
Distribution	£	6 607	£	4 557	£	6 985
Actions émises en circulation		611		427		531
VNI par action	£	10,81	£	10,68	£	13,17
Administrations en HKD (non couverte) :						
Distribution	HKD	34 774	HKD	10 505	HKD	12 810
Actions émises en circulation		4 033		1 244		1 244
VNI par action	HKD	8,62	HKD	8,44	HKD	10,30
Administrations en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	309 125	SEK	901 901	SEK	936 226
Actions émises en circulation		29 862		88 869		76 221
VNI par action	SEK	10,35	SEK	10,15	SEK	12,28
Administrations en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	14 957	SGD	2 918	SGD	5 459
Actions émises en circulation		1 796		354		542
VNI par action	SGD	8,33	SGD	8,24	SGD	10,08
Catégorie E :						
Capitalisation	\$	715 315	\$	605 749	\$	799 659
Actions émises en circulation		42 330		36 905		40 796
VNI par action	\$	16,90	\$	16,41	\$	19,60
Distribution	\$	234 329	\$	216 440	\$	341 550
Actions émises en circulation		19 787		18 589		24 037
VNI par action	\$	11,84	\$	11,64	\$	14,21
Catégorie E en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	50 739	CHF	52 629	CHF	78 253
Actions émises en circulation		5 111		5 342		6 476
VNI par action	CHF	9,93	CHF	9,85	CHF	12,08
Catégorie E en EUR (exposition au risque de change) :						
Distribution	€	1 339	€	1 340	€	3 077
Actions émises en circulation		148		148		288
VNI par action	€	9,03	€	9,03	€	10,67

	Au 30 juin 2023		Au 31 déc. 2022		Au 31 déc. 2021	
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)					
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	350 509	€	451 796	€	630 730
Actions émises en circulation		23 856		31 264		35 735
VNI par action	€	14,69	€	14,45	€	17,65
Distribution	€	193 818	€	197 011	€	271 438
Actions émises en circulation		23 730		24 230		26 741
VNI par action	€	8,17	€	8,13	€	10,15
Catégorie E en GBP (couverte) :						
Distribution	£	23 084	£	20 979	£	31 335
Actions émises en circulation		2 045		1 881		2 279
VNI par action	£	11,29	£	11,15	£	13,75
Catégorie E en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	39 609	SGD	30 453	SGD	37 343
Actions émises en circulation		4 467		3 472		3 481
VNI par action	SGD	8,87	SGD	8,77	SGD	10,73
H Institutions :						
Capitalisation	\$	651 396	\$	282 176	\$	168 210
Actions émises en circulation		32 558		14 572		7 327
VNI par action	\$	20,01	\$	19,36	\$	22,96
Distribution	\$	15 014	\$	17 320	\$	14 287
Actions émises en circulation		1 705		2 000		1 351
VNI par action	\$	8,81	\$	8,66	\$	10,57
H Institutions (exposition au risque de change) :						
Capitalisation	\$	10 495	\$	184 082	\$	10
Actions émises en circulation		1 255		22 850		1
VNI par action	\$	8,36	\$	8,06	\$	9,85
M Détail :						
Distribution	\$	27 517	\$	25 037	\$	49 229
Actions émises en circulation		3 069		2 840		4 577
VNI par action	\$	8,97	\$	8,82	\$	10,76
Distribution II	\$	95 460	\$	86 672	\$	120 251
Actions émises en circulation		11 844		10 861		12 179
VNI par action	\$	8,06	\$	7,98	\$	9,87
M Détail en HKD (non couverte) :						
Distribution	HKD	8 840	HKD	8 376	HKD	9 145
Actions émises en circulation		1 024		990		887
VNI par action	HKD	8,64	HKD	8,46	HKD	10,31
Catégorie R :						
Capitalisation	\$	12 877	\$	16 316	\$	28 433
Actions émises en circulation		1 055		1 381		2 028
VNI par action	\$	12,20	\$	11,81	\$	14,02
Distribution	\$	5 517	\$	4 870	\$	6 925
Actions émises en circulation		621		558		650
VNI par action	\$	8,88	\$	8,73	\$	10,66
Catégorie R en EUR (couverte) :						
Distribution	€	2 320	€	2 758	€	6 026
Actions émises en circulation		304		364		636
VNI par action	€	7,62	€	7,59	€	9,47
Catégorie R en GBP (couverte) :						
Distribution	£	7 492	£	8 117	£	11 449
Actions émises en circulation		910		998		1 141
VNI par action	£	8,24	£	8,14	£	10,04
Catégorie T :						
Capitalisation	\$	26 667	\$	28 595	\$	42 303
Actions émises en circulation		2 529		2 786		3 438
VNI par action	\$	10,54	\$	10,26	\$	12,30
Catégorie T en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	4 449	€	3 508	€	4 875
Actions émises en circulation		491		393		446
VNI par action	€	9,05	€	8,92	€	10,94

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)			
Catégorie W :			
Capitalisation	\$ 46 198	\$ 32 822	\$ 66 615
Actions émises en circulation	5 185	3 811	6 543
VNI par action	\$ 8,91	\$ 8,61	\$ 10,18
Distribution	\$ 16 919	\$ 11 533	\$ 20 732
Actions émises en circulation	2 072	1 437	2 116
VNI par action	\$ 8,16	\$ 8,03	\$ 9,80
Catégorie W en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 20 785	CHF 20 144	CHF 32 864
Actions émises en circulation	2 486	2 440	3 278
VNI par action	CHF 8,36	CHF 8,26	CHF 10,03
Catégorie W en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 13 389	€ 14 812	€ 150 079
Actions émises en circulation	1 576	1 781	14 925
VNI par action	€ 8,49	€ 8,31	€ 10,06
Distribution	€ 4 521	€ 2 194	€ 3 545
Actions émises en circulation	582	283	367
VNI par action	€ 7,77	€ 7,74	€ 9,67
Catégorie W en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 5 032	£ 3 270	£ 515
Actions émises en circulation	575	385	51
VNI par action	£ 8,75	£ 8,50	£ 10,15
Distribution	£ 12 924	£ 6 970	£ 16 284
Actions émises en circulation	1 613	881	1 668
VNI par action	£ 8,01	£ 7,92	£ 9,76
Catégorie W en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 10 224	SGD 4 506	SGD 810
Actions émises en circulation	1 263	563	83
VNI par action	SGD 8,09	SGD 8,01	SGD 9,79
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund			
Actif net	\$ 1 819 349	\$ 1 369 890	\$ 1 189 563
Institutions :			
Capitalisation	\$ 64 807	\$ 61 632	\$ 39 212
Actions émises en circulation	6 067	5 924	3 211
VNI par action	\$ 10,68	\$ 10,40	\$ 12,21
Distribution	\$ 118 837	\$ 10 347	\$ 19 429
Actions émises en circulation	13 246	1 167	1 825
VNI par action	\$ 8,97	\$ 8,86	\$ 10,65
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 203 051	CHF 190 278	CHF 185 627
Actions émises en circulation	21 510	20 258	16 381
VNI par action	CHF 9,44	CHF 9,39	CHF 11,33
Distribution	CHF 2 855	CHF 2 020	CHF 3 002
Actions émises en circulation	360	253	304
VNI par action	CHF 7,93	CHF 8,00	CHF 9,88
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 524 026	€ 220 186	€ 229 148
Actions émises en circulation	54 149	23 072	19 996
VNI par action	€ 9,68	€ 9,54	€ 11,46

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)			
Distribution	€ 232 166	€ 320 757	€ 42 749
Actions émises en circulation	28 732	39 702	4 306
VNI par action	€ 8,08	€ 8,08	€ 9,93
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 50 989	£ 72 284	£ 83 370
Actions émises en circulation	5 028	7 283	7 085
VNI par action	£ 10,14	£ 9,92	£ 11,77
Distribution	£ 103 888	£ 87 512	£ 155 708
Actions émises en circulation	11 782	9 955	14 592
VNI par action	£ 8,82	£ 8,79	£ 10,67
Institutions en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 26 192	SEK 11 028	S/O
Actions émises en circulation	249	106	S/O
VNI par action	SEK 105,23	SEK 103,64	S/O
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 10	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 10,05	S/O	S/O
Distribution	€ 10	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,92	S/O	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 223	\$ 217	\$ 141
Actions émises en circulation	25	25	14
VNI par action	\$ 8,78	\$ 8,56	\$ 10,09
Administrations en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 3 672 748	SEK 3 047 191	SEK 2 293 688
Actions émises en circulation	41 686	35 030	21 953
VNI par action	SEK 88,10	SEK 86,99	SEK 104,48
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 6 254	\$ 1 735	\$ 3 820
Actions émises en circulation	705	200	372
VNI par action	\$ 8,87	\$ 8,68	\$ 10,28
Distribution	\$ 3 351	\$ 446	\$ 834
Actions émises en circulation	392	53	82
VNI par action	\$ 8,55	\$ 8,45	\$ 10,15
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 356	CHF 491	CHF 194
Actions émises en circulation	43	60	19
VNI par action	CHF 8,22	CHF 8,22	CHF 10,01
Distribution	CHF 24	CHF 24	CHF 30
Actions émises en circulation	3	3	3
VNI par action	CHF 7,93	CHF 8,00	CHF 9,87
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 23 016	€ 3 370	€ 7 130
Actions émises en circulation	2 748	406	709
VNI par action	€ 8,38	€ 8,29	€ 10,05
Distribution	€ 568	€ 581	€ 869
Actions émises en circulation	70	72	88
VNI par action	€ 8,07	€ 8,07	€ 9,92

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)			
Catégorie E en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 658	£ 420	£ 503
Actions émises en circulation	76	50	50
VNI par action	£ 8,63	£ 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	\$ 4 349	\$ 19 339	\$ 22 582
Actions émises en circulation	434	1 986	1 986
VNI par action	\$ 10,02	\$ 9,74	\$ 11,37
Fonds Global Low Duration Real Return Fund			
Actif net	\$ 1 253 157	\$ 1 364 375	\$ 1 199 076
Institutions :			
Capitalisation	\$ 73 700	\$ 136 292	\$ 150 363
Actions émises en circulation	6 167	11 554	12 580
VNI par action	\$ 11,95	\$ 11,80	\$ 11,95
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 13 325	CHF 22 752	CHF 32 711
Actions émises en circulation	1 360	2 303	3 190
VNI par action	CHF 9,80	CHF 9,88	CHF 10,25
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 338 233	€ 498 384	€ 518 804
Actions émises en circulation	32 950	48 614	48 941
VNI par action	€ 10,26	€ 10,25	€ 10,60
Distribution	€ 33 165	€ 34 131	€ 45 289
Actions émises en circulation	3 810	3 856	4 630
VNI par action	€ 8,70	€ 8,85	€ 9,78
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 35 943	£ 55 816	£ 63 979
Actions émises en circulation	3 274	5 128	5 771
VNI par action	£ 10,98	£ 10,88	£ 11,09
Distribution	£ 64 163	£ 62 640	£ 57 902
Actions émises en circulation	7 120	6 761	5 720
VNI par action	£ 9,01	£ 9,26	£ 10,12
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 591 060	SGD 351 313	S/O
Actions émises en circulation	58 358	34 943	S/O
VNI par action	SGD 10,13	SGD 10,05	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 6 543	\$ 6 751	\$ 5 146
Actions émises en circulation	567	591	443
VNI par action	\$ 11,55	\$ 11,42	\$ 11,61
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 28 640	\$ 34 924	\$ 26 574
Actions émises en circulation	2 608	3 206	2 386
VNI par action	\$ 10,98	\$ 10,89	\$ 11,14
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 146 816	€ 177 147	€ 153 469
Actions émises en circulation	15 565	18 721	15 545
VNI par action	€ 9,43	€ 9,46	€ 9,87
Fonds Global Real Return Fund			
Actif net	\$ 2 510 669	\$ 2 571 862	\$ 3 703 379
Institutions :			
Capitalisation	\$ 294 010	\$ 272 591	\$ 380 827
Actions émises en circulation	13 397	12 628	14 784
VNI par action	\$ 21,95	\$ 21,59	\$ 25,76
Distribution	\$ 6 072	\$ 12 328	\$ 22 531
Actions émises en circulation	395	796	1 136
VNI par action	\$ 15,37	\$ 15,49	\$ 19,84

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Global Real Return Fund (suite)			
Institutions (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	\$ 47 610	\$ 47 075	\$ 68 405
Actions émises en circulation	4 759	4 828	5 543
VNI par action	\$ 10,00	\$ 9,75	\$ 12,34
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 61 873	CHF 56 131	CHF 63 005
Actions émises en circulation	4 726	4 267	3 907
VNI par action	CHF 13,09	CHF 13,15	CHF 16,12
Distribution	CHF 27 549	CHF 33 615	CHF 38 988
Actions émises en circulation	3 293	3 898	3 438
VNI par action	CHF 8,37	CHF 8,62	CHF 11,34
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 768 249	€ 824 251	€ 1 075 404
Actions émises en circulation	42 301	45 572	48 681
VNI par action	€ 18,16	€ 18,09	€ 22,09
Distribution	€ 86 097	€ 98 750	€ 140 728
Actions émises en circulation	6 903	7 750	8 415
VNI par action	€ 12,47	€ 12,74	€ 16,72
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 37 444	£ 38 820	£ 45 209
Actions émises en circulation	3 144	3 298	3 177
VNI par action	£ 11,91	£ 11,77	£ 14,23
Distribution	£ 217 129	£ 205 454	£ 276 097
Actions émises en circulation	27 864	25 531	26 297
VNI par action	£ 7,79	£ 8,05	£ 10,50
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 237 375	SGD 236 796	SGD 307 106
Actions émises en circulation	14 864	14 984	16 250
VNI par action	SGD 15,97	SGD 15,80	SGD 18,90
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 41 510	\$ 63 935	\$ 92 993
Actions émises en circulation	2 027	3 170	3 850
VNI par action	\$ 20,47	\$ 20,17	\$ 24,16
Distribution	\$ 12 164	\$ 9 038	\$ 31 044
Actions émises en circulation	909	669	1 795
VNI par action	\$ 13,39	\$ 13,51	\$ 17,30
Investisseurs en CHF (couverte) :			
Distribution	CHF 2 223	CHF 2 516	CHF 5 139
Actions émises en circulation	211	232	360
VNI par action	CHF 10,54	CHF 10,85	CHF 14,28
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 22 062	€ 22 838	€ 36 406
Actions émises en circulation	1 299	1 347	1 752
VNI par action	€ 16,99	€ 16,95	€ 20,77
Administrations :			
Capitalisation	\$ 38 210	\$ 43 396	\$ 71 230
Actions émises en circulation	1 910	2 200	3 010
VNI par action	\$ 20,01	\$ 19,73	\$ 23,66
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 128 901	\$ 153 574	\$ 231 761
Actions émises en circulation	6 876	8 292	10 391
VNI par action	\$ 18,75	\$ 18,52	\$ 22,30
Distribution	\$ 31 116	\$ 38 490	\$ 53 098
Actions émises en circulation	2 414	2 958	3 187
VNI par action	\$ 12,89	\$ 13,01	\$ 16,66
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 232 045	€ 234 441	€ 321 175
Actions émises en circulation	14 941	15 090	16 773
VNI par action	€ 15,53	€ 15,54	€ 19,15
Catégorie E en GBP (couverte) :			
Distribution	S/O	S/O	£ 4 354
Actions émises en circulation	S/O	S/O	282
VNI par action	S/O	S/O	£ 15,45

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Global Real Return Fund (suite)			
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 89 516	\$ 90 138	\$ 150 924
Actions émises en circulation	4 211	4 307	6 032
VNI par action	\$ 21,26	\$ 20,93	\$ 25,02
Catégorie R :			
Capitalisation	\$ 1 472	\$ 1 569	\$ 7 292
Actions émises en circulation	122	132	514
VNI par action	\$ 12,03	\$ 11,85	\$ 14,18
Catégorie R en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 7 299	£ 8 283	£ 12 683
Actions émises en circulation	652	747	944
VNI par action	£ 11,20	£ 11,09	£ 13,44
Fonds Income Fund			
Actif net	\$ 64 527 567	\$ 57 980 327	\$ 73 579 726
Institutions :			
Capitalisation	\$ 10 183 487	\$ 9 197 801	\$ 10 989 198
Actions émises en circulation	624 022	582 256	643 353
VNI par action	\$ 16,32	\$ 15,80	\$ 17,08
Distribution	\$ 4 775 220	\$ 4 597 148	\$ 5 308 194
Actions émises en circulation	451 613	435 389	442 049
VNI par action	\$ 10,57	\$ 10,56	\$ 12,01
Institutions en AUD (couverte) :			
Capitalisation	AUD 90 503	AUD 80 591	AUD 96 588
Actions émises en circulation	8 351	7 611	8 329
VNI par action	AUD 10,84	AUD 10,59	AUD 11,60
Distribution	S/O	S/O	AUD 14
Actions émises en circulation	S/O	S/O	1
VNI par action	S/O	S/O	AUD 9,84
Institutions en BRL (couverte) :			
Capitalisation	\$ 309 492	\$ 274 136	\$ 561 362
Actions émises en circulation	19 367	20 003	43 619
VNI par action	\$ 15,98	\$ 13,70	\$ 12,87
Institutions en CAD (couverte) :			
Capitalisation	CAD 78 028	CAD 83 552	CAD 98 436
Actions émises en circulation	6 190	6 821	7 406
VNI par action	CAD 12,61	CAD 12,25	CAD 13,29
Distribution	CAD 124 176	CAD 117 940	CAD 138 770
Actions émises en circulation	13 674	12 956	13 346
VNI par action	CAD 9,08	CAD 9,10	CAD 10,40
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 307 727	CHF 293 823	CHF 326 885
Actions émises en circulation	27 457	26 495	26 540
VNI par action	CHF 11,21	CHF 11,09	CHF 12,32
Distribution	CHF 137 634	CHF 135 996	CHF 178 124
Actions émises en circulation	17 840	17 253	19 281
VNI par action	CHF 7,71	CHF 7,88	CHF 9,24
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 5 193 931	€ 4 856 302	€ 6 397 698
Actions émises en circulation	374 288	356 885	424 812
VNI par action	€ 13,88	€ 13,61	€ 15,06

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Income Fund (suite)			
Distribution	€ 816 287	€ 858 841	€ 1 216 992
Actions émises en circulation	92 957	96 621	117 285
VNI par action	€ 8,78	€ 8,89	€ 10,38
Distribution II	€ 21 441	€ 13 739	€ 21 567
Actions émises en circulation	2 430	1 555	2 138
VNI par action	€ 8,82	€ 8,84	€ 10,09
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 190 987	£ 179 687	£ 223 422
Actions émises en circulation	17 973	17 378	19 797
VNI par action	£ 10,63	£ 10,34	£ 11,29
Distribution	£ 475 213	£ 437 940	£ 465 680
Actions émises en circulation	52 738	48 401	44 776
VNI par action	£ 9,01	£ 9,05	£ 10,40
Institutions en HKD (non couverte) :			
Distribution	HKD 314 876	HKD 448 226	HKD 798 164
Actions émises en circulation	32 461	46 468	72 832
VNI par action	HKD 9,70	HKD 9,65	HKD 10,96
Institutions en JPY (couverte) :			
Capitalisation	¥ 1 096 657	S/O	¥ 255 548
Actions émises en circulation	1 088	S/O	229
VNI par action	¥ 1 008,00	S/O	¥ 1 118,00
Institutions en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 2 307 266	NOK 2 153 310	NOK 2 187 743
Actions émises en circulation	20 880	19 915	18 488
VNI par action	NOK 110,50	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
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 65 749	SGD 57 007	SGD 46 472
Actions émises en circulation	6 306	5 614	4 222
VNI par action	SGD 10,43	SGD 10,15	SGD 11,01
Distribution	SGD 279 576	SGD 233 054	SGD 277 493
Actions émises en circulation	29 562	24 522	25 607
VNI par action	SGD 9,46	SGD 9,50	SGD 10,84
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 1 886 447	\$ 1 938 128	\$ 2 841 494
Actions émises en circulation	142 482	150 961	203 964
VNI par action	\$ 13,24	\$ 12,84	\$ 13,93
Distribution	\$ 1 392 843	\$ 1 424 611	\$ 1 709 869
Actions émises en circulation	149 643	152 992	160 791
VNI par action	\$ 9,31	\$ 9,31	\$ 10,63
Investisseurs en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 75 629	AUD 64 155	AUD 73 714
Actions émises en circulation	8 817	7 404	7 348
VNI par action	AUD 8,58	AUD 8,66	AUD 10,03
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 225 120	€ 212 831	€ 508 040
Actions émises en circulation	20 470	19 702	42 352
VNI par action	€ 11,00	€ 10,80	€ 12,00

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Income Fund (suite)			
Distribution	€ 84 129	€ 75 705	€ 105 743
Actions émises en circulation	11 007	9 766	11 634
VNI par action	€ 7,64	€ 7,75	€ 9,09
Distribution A	€ 27 482	€ 29 277	€ 37 920
Actions émises en circulation	3 386	3 673	4 052
VNI par action	€ 8,12	€ 7,97	€ 9,36
Investisseurs en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 18 078	£ 16 799	£ 9 219
Actions émises en circulation	2 127	1 965	935
VNI par action	£ 8,50	£ 8,55	£ 9,86
Investisseurs en JPY (couverte) :			
Capitalisation	¥ 1 352	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	¥ 1 004,00	S/O	S/O
Investisseurs en RMB (couverte) :			
Capitalisation	CNH 77 857	CNH 66 886	CNH 124 077
Actions émises en circulation	663	579	994
VNI par action	CNH 117,35	CNH 115,46	CNH 124,87
Investisseurs en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 11 509	SGD 6 150	SGD 1 979
Actions émises en circulation	1 142	625	185
VNI par action	SGD 10,08	SGD 9,84	SGD 10,70
Distribution	SGD 49 157	SGD 47 450	SGD 67 208
Actions émises en circulation	5 570	5 340	6 605
VNI par action	SGD 8,83	SGD 8,89	SGD 10,18
Administrations :			
Capitalisation	\$ 840 852	\$ 744 526	\$ 912 059
Actions émises en circulation	71 736	65 457	73 786
VNI par action	\$ 11,72	\$ 11,37	\$ 12,36
Distribution	\$ 3 395 699	\$ 2 930 269	\$ 3 699 459
Actions émises en circulation	341 794	294 606	325 103
VNI par action	\$ 9,93	\$ 9,95	\$ 11,38
Administrations en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 341 078	AUD 286 887	AUD 316 049
Actions émises en circulation	38 789	32 273	30 677
VNI par action	AUD 8,79	AUD 8,89	AUD 10,30
Administrations en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 82 726	€ 96 175	€ 193 792
Actions émises en circulation	7 577	8 961	16 228
VNI par action	€ 10,92	€ 10,73	€ 11,94
Distribution	€ 287 515	€ 266 419	€ 308 049
Actions émises en circulation	37 090	33 865	33 362
VNI par action	€ 7,75	€ 7,87	€ 9,23
Administrations en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 133 826	£ 112 506	£ 140 149
Actions émises en circulation	16 298	13 611	14 660
VNI par action	£ 8,21	£ 8,27	£ 9,56
Administrations en HKD (non couverte) :			
Distribution	HKD 4 704 034	HKD 3 221 408	HKD 4 681 912
Actions émises en circulation	530 871	364 591	463 488
VNI par action	HKD 8,86	HKD 8,84	HKD 10,10

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Income Fund (suite)			
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 1 392 280	SGD 971 804	SGD 1 080 475
Actions émises en circulation	143 166	99 186	96 129
VNI par action	SGD 9,72	SGD 9,80	SGD 11,24
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 5 276 558	\$ 4 837 460	\$ 6 088 898
Actions émises en circulation	355 373	335 073	386 539
VNI par action	\$ 14,85	\$ 14,44	\$ 15,75
Distribution	\$ 8 009 068	\$ 6 857 888	\$ 8 765 914
Actions émises en circulation	847 381	723 233	804 221
VNI par action	\$ 9,45	\$ 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 718 044	AUD 595 621	AUD 699 187
Actions émises en circulation	87 174	71 382	71 928
VNI par action	AUD 8,24	AUD 8,34	AUD 9,72
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 77 758	CHF 80 590	CHF 101 113
Actions émises en circulation	7 257	7 568	8 472
VNI par action	CHF 10,71	CHF 10,65	CHF 11,93
Distribution	CHF 103 829	CHF 80 502	CHF 117 164
Actions émises en circulation	14 800	11 178	13 731
VNI par action	CHF 7,02	CHF 7,20	CHF 8,53
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 4 810 355	€ 4 356 288	€ 5 062 678
Actions émises en circulation	381 347	350 614	364 865
VNI par action	€ 12,61	€ 12,42	€ 13,88
Distribution	€ 3 520 179	€ 3 436 223	€ 4 359 865
Actions émises en circulation	448 518	430 505	462 802
VNI par action	€ 7,85	€ 7,98	€ 9,42
Distribution II	€ 138 423	€ 121 587	€ 125 779
Actions émises en circulation	15 696	13 705	12 308
VNI par action	€ 8,82	€ 8,87	€ 10,22
Distribution II Q	€ 35 750	€ 38 028	€ 52 706
Actions émises en circulation	4 110	4 345	5 208
VNI par action	€ 8,70	€ 8,75	€ 10,12
Catégorie E en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 245 413	£ 208 926	£ 236 936
Actions émises en circulation	31 032	26 188	25 560
VNI par action	£ 7,91	£ 7,98	£ 9,27
Catégorie E en HKD (non couverte) :			
Distribution	HKD 4 185 899	HKD 3 442 414	HKD 4 704 540
Actions émises en circulation	468 748	385 795	459 225
VNI par action	HKD 8,93	HKD 8,92	HKD 10,24

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Income Fund (suite)			
Catégorie E en JPY (couverte) :			
Capitalisation	¥ 8 506 391	¥ 4 076 871	¥ 743 601
Actions émises en circulation	8 857	4 248	692
VNI par action	¥ 960,00	¥ 960,00	¥ 1 075,00
Distribution	¥ 1 633 190	¥ 1 381	S/O
Actions émises en circulation	1 697	1	S/O
VNI par action	¥ 962,00	¥ 992,00	S/O
Catégorie E en RMB (couverte) :			
Distribution	CNH 699 958	CNH 490 076	CNH 671 398
Actions émises en circulation	6 542	4 497	5 397
VNI par action	CNH 107,00	CNH 108,97	CNH 124,39
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 3 648 260	SGD 2 537 340	SGD 2 784 269
Actions émises en circulation	424 620	292 512	278 445
VNI par action	SGD 8,59	SGD 8,67	SGD 10,00
G Détail en EUR (couverte) :			
Distribution	€ 27 873	€ 18 496	€ 29 724
Actions émises en circulation	3 552	2 393	3 263
VNI par action	€ 7,85	€ 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	\$ 722 457	\$ 669 952	\$ 770 236
Actions émises en circulation	63 301	60 591	64 313
VNI par action	\$ 11,41	\$ 11,06	\$ 11,98
Distribution	\$ 345 805	\$ 287 285	\$ 333 808
Actions émises en circulation	37 875	31 482	32 084
VNI par action	\$ 9,13	\$ 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	\$ 89 368	\$ 82 073	\$ 70 929
Actions émises en circulation	8 499	8 054	6 420
VNI par action	\$ 10,51	\$ 10,19	\$ 11,05
Distribution	\$ 58 929	\$ 61 635	\$ 84 900
Actions émises en circulation	6 400	6 695	8 082
VNI par action	\$ 9,21	\$ 9,21	\$ 10,50
Catégorie R en EUR (couverte) :			
Distribution	€ 12 270	€ 12 865	€ 16 112
Actions émises en circulation	1 515	1 567	1 678
VNI par action	€ 8,10	€ 8,21	€ 9,60
Catégorie R en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 25 325	£ 20 954	£ 33 995
Actions émises en circulation	2 697	2 220	3 123
VNI par action	£ 9,39	£ 9,44	£ 10,88

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Income Fund (suite)			
Catégorie T :			
Capitalisation	\$ 296 211	\$ 295 923	\$ 371 744
Actions émises en circulation	24 351	24 971	28 634
VNI par action	\$ 12,16	\$ 11,85	\$ 12,98
Distribution	\$ 109 271	\$ 102 600	\$ 130 671
Actions émises en circulation	13 148	12 279	13 542
VNI par action	\$ 8,31	\$ 8,36	\$ 9,65
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 241 934	€ 226 266	€ 268 086
Actions émises en circulation	23 272	22 053	23 304
VNI par action	€ 10,40	€ 10,26	€ 11,50
Distribution	€ 171 662	€ 165 117	€ 217 088
Actions émises en circulation	24 740	23 351	25 890
VNI par action	€ 6,94	€ 7,07	€ 8,38
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 189 355	\$ 219 519	\$ 162 794
Actions émises en circulation	10 960	13 161	9 076
VNI par action	\$ 17,28	\$ 16,68	\$ 17,94
Catégorie Z en AUD (couverte) :			
Distribution II	AUD 1 304 615	AUD 1 339 063	AUD 1 451 394
Actions émises en circulation	133 612	136 394	129 096
VNI par action	AUD 9,76	AUD 9,82	AUD 11,24
Fonds Income Fund II			
Actif net	\$ 97 717	\$ 56 653	\$ 27 770
Institutions :			
Capitalisation	\$ 23 146	\$ 22 431	\$ 24 374
Actions émises en circulation	2 397	2 396	2 396
VNI par action	\$ 9,66	\$ 9,36	\$ 10,17
Distribution	\$ 10	S/O	\$ 10
Actions émises en circulation	1	S/O	1
VNI par action	\$ 10,07	S/O	\$ 9,94
Catégorie E :			
Distribution	\$ 25 759	\$ 17 904	\$ 1 730
Actions émises en circulation	2 975	2 069	174
VNI par action	\$ 8,66	\$ 8,65	\$ 9,92
Catégorie E en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 9 747	AUD 2 121	AUD 365
Actions émises en circulation	1 153	249	37
VNI par action	AUD 8,46	AUD 8,53	AUD 9,90
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Distribution	€ 4 874	€ 3 223	€ 494
Actions émises en circulation	589	385	50
VNI par action	€ 8,27	€ 8,38	€ 9,85
Catégorie E en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 10 435	£ 2 811	£ 196
Actions émises en circulation	1 225	329	20
VNI par action	£ 8,52	£ 8,55	£ 9,90
Catégorie E en HKD (non couverte) :			
Distribution	HKD 185 961	HKD 62 900	HKD 2 462
Actions émises en circulation	21 259	7 226	247
VNI par action	HKD 8,75	HKD 8,70	HKD 9,98

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021	
Fonds Income Fund II (suite)				
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
Fonds Inflation Multi-Asset Fund				
Actif net	\$ 324 178	\$ 403 078	\$	164 345
Institutions :				
Capitalisation	\$ 83 897	\$ 83 455	\$	68 012
Actions émises en circulation	7 498	7 503		5 798
VNI par action	\$ 11,19	\$ 11,12	\$	11,73
Institutions en EUR (partiellement couverte) :				
Capitalisation	€ 58 229	€ 82 243	€	4 749
Actions émises en circulation	6 229	8 718		477
VNI par action	€ 9,35	€ 9,43	€	9,96
Institutions en GBP (partiellement couverte) :				
Capitalisation	£ 3 788	£ 3 543	£	22 843
Actions émises en circulation	333	308		1 924
VNI par action	£ 11,37	£ 11,50	£	11,87
Administrations :				
Distribution II	\$ 2 460	\$ 2 961		S/O
Actions émises en circulation	287	338		S/O
VNI par action	\$ 8,58	\$ 8,75		S/O
Administrations en SGD (couverte) :				
Distribution II	SGD 6 518	SGD 10 723		S/O
Actions émises en circulation	743	1 197		S/O
VNI par action	SGD 8,77	SGD 8,95		S/O
Catégorie E :				
Capitalisation	\$ 65 566	\$ 85 842	\$	14 809
Actions émises en circulation	6 615	8 673		1 405
VNI par action	\$ 9,91	\$ 9,90	\$	10,54
Distribution II	\$ 9	9		S/O
Actions émises en circulation	1	1		S/O
VNI par action	\$ 9,08	\$ 9,27		S/O
Catégorie E en AUD (partiellement couverte) :				
Capitalisation	AUD 333	AUD 334		S/O
Actions émises en circulation	36	36		S/O
VNI par action	AUD 9,34	AUD 9,35		S/O
Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :				
Capitalisation	€ 81 118	€ 110 990	€	33 996
Actions émises en circulation	8 865	11 966		3 436
VNI par action	€ 9,15	€ 9,28	€	9,89
Distribution	€ 9 280	€ 11 302	€	5 738
Actions émises en circulation	1 108	1 312		608
VNI par action	€ 8,38	€ 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	£ 9,26	£ 9,41		S/O
Catégorie E en SGD (partiellement couverte) :				
Capitalisation	SGD 13	SGD 13		S/O
Actions émises en circulation	1	1		S/O
VNI par action	SGD 9,34	SGD 9,35		S/O
H Institutions :				
Capitalisation	\$ 9	9		S/O
Actions émises en circulation	1	1		S/O
VNI par action	\$ 9,50	\$ 9,45		S/O
M Détail :				
Distribution II	\$ 209	9		S/O
Actions émises en circulation	23	1		S/O
VNI par action	\$ 9,16	\$ 9,32		S/O

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021	
Fonds Low Average Duration Fund				
Actif net	\$ 886 012	\$ 1 072 758	\$	1 179 138
Institutions :				
Capitalisation	\$ 552 752	\$ 640 710	\$	747 732
Actions émises en circulation	35 140	41 077		45 606
VNI par action	\$ 15,73	\$ 15,60	\$	16,40
Distribution	\$ 34 066	\$ 53 185	\$	33 312
Actions émises en circulation	3 471	5 377		3 159
VNI par action	\$ 9,81	\$ 9,89	\$	10,54
Institutions en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 23 466	€ 37 536	€	35 456
Actions émises en circulation	2 423	3 864		3 402
VNI par action	€ 9,68	€ 9,71	€	10,42
Distribution	€ 3 309	€ 8 986	€	10 023
Actions émises en circulation	477	1 270		1 302
VNI par action	€ 6,94	€ 7,08	€	7,70
Institutions en GBP (couverte) :				
Capitalisation	£ 18 782	£ 17 044	£	13 877
Actions émises en circulation	1 919	1 748		1 347
VNI par action	£ 9,79	£ 9,75	£	10,30
Distribution	£ 3 056	£ 3 285	£	4 225
Actions émises en circulation	347	367		439
VNI par action	£ 8,81	£ 8,95	£	9,64
Investisseurs :				
Capitalisation	\$ 14 605	\$ 16 532	\$	20 960
Actions émises en circulation	992	1 131		1 359
VNI par action	\$ 14,72	\$ 14,62	\$	15,42
Distribution	\$ 1 858	\$ 2 022	\$	7 973
Actions émises en circulation	191	206		762
VNI par action	\$ 9,74	\$ 9,81	\$	10,46
Administrations :				
Capitalisation	\$ 9 370	\$ 10 755	\$	11 016
Actions émises en circulation	654	755		733
VNI par action	\$ 14,32	\$ 14,24	\$	15,04
Catégorie E :				
Capitalisation	\$ 44 437	\$ 47 980	\$	52 498
Actions émises en circulation	3 670	3 979		4 104
VNI par action	\$ 12,11	\$ 12,06	\$	12,79
Distribution	\$ 3 957	\$ 5 384	\$	6 751
Actions émises en circulation	391	528		621
VNI par action	\$ 10,12	\$ 10,20	\$	10,87
Catégorie E en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 23 098	€ 25 480	€	18 812
Actions émises en circulation	2 959	3 238		2 209
VNI par action	€ 7,81	€ 7,87	€	8,52
H Institutions :				
Capitalisation	\$ 134 383	\$ 186 190	\$	186 367
Actions émises en circulation	11 384	15 891		15 108
VNI par action	\$ 11,81	\$ 11,72	\$	12,34
Distribution	\$ 1 427	\$ 1 521	\$	7 574
Actions émises en circulation	151	159		745
VNI par action	\$ 9,46	\$ 9,54	\$	10,16
Catégorie R :				
Capitalisation	\$ 6 982	\$ 7 183	\$	7 325
Actions émises en circulation	663	687		665
VNI par action	\$ 10,52	\$ 10,45	\$	11,02
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund				
Actif net	\$ 798 217	\$ 654 749	\$	806 869
Institutions :				
Capitalisation	\$ 237 291	\$ 120 881	\$	94 445
Actions émises en circulation	20 324	10 562		7 805
VNI par action	\$ 11,68	\$ 11,44	\$	12,10

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)			
Distribution	\$ 16 574	\$ 17 001	\$ 10
Actions émises en circulation	1 795	1 859	1
VNI par action	\$ 9,23	\$ 9,15	\$ 9,82
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 422 000	€ 417 993	€ 520 319
Actions émises en circulation	41 989	41 937	48 370
VNI par action	€ 10,05	€ 9,97	€ 10,76
Distribution	€ 120	€ 133	€ 928
Actions émises en circulation	14	15	95
VNI par action	€ 8,88	€ 8,90	€ 9,75
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 19 517	£ 18 388	£ 18 462
Actions émises en circulation	1 784	1 708	1 611
VNI par action	£ 10,94	£ 10,77	£ 11,46
Distribution	£ 3 857	£ 3 910	£ 18 096
Actions émises en circulation	426	432	1 849
VNI par action	£ 9,06	£ 9,06	£ 9,79
Institutions en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 166 958	NOK 159 169	NOK 441 039
Actions émises en circulation	1 642	1 581	4 119
VNI par action	NOK 101,70	NOK 100,63	NOK 107,06
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 35 305	€ 25 901	€ 17 694
Actions émises en circulation	3 824	2 816	1 767
VNI par action	€ 9,23	€ 9,20	€ 10,01
Fonds Low Duration Income Fund			
Actif net	\$ 1 455 385	\$ 1 084 380	\$ 1 367 475
Institutions :			
Capitalisation	\$ 176 283	\$ 186 357	\$ 275 963
Actions émises en circulation	15 608	17 111	24 381
VNI par action	\$ 11,29	\$ 10,89	\$ 11,32
Distribution	\$ 5 902	\$ 11 734	\$ 13 398
Actions émises en circulation	610	1 229	1 305
VNI par action	\$ 9,67	\$ 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
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 641 714	€ 633 070	€ 666 067
Actions émises en circulation	63 064	63 769	63 153
VNI par action	€ 10,18	€ 9,93	€ 10,55
Distribution	€ 8	€ 8	€ 60 301
Actions émises en circulation	1	1	6 036
VNI par action	€ 9,14	€ 9,14	€ 9,99
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 207 672	£ 3 280	£ 5 158
Actions émises en circulation	19 400	316	475
VNI par action	£ 10,70	£ 10,37	£ 10,85

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Low Duration Income Fund (suite)			
Distribution	£ 106 712	£ 50 073	£ 130 935
Actions émises en circulation	11 717	5 539	13 372
VNI par action	£ 9,11	£ 9,04	£ 9,79
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 16 488	SGD 15 840	SGD 19 822
Actions émises en circulation	1 580	1 566	1 883
VNI par action	SGD 10,43	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	\$ 45 350	\$ 27 537	\$ 16 491
Actions émises en circulation	4 194	2 629	1 502
VNI par action	\$ 10,81	\$ 10,47	\$ 10,98
Distribution	\$ 7 746	\$ 8 193	\$ 9 075
Actions émises en circulation	831	885	904
VNI par action	\$ 9,32	\$ 9,25	\$ 10,04
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 58 816	€ 31 442	€ 16 611
Actions émises en circulation	6 044	3 297	1 625
VNI par action	€ 9,73	€ 9,54	€ 10,22
Distribution	€ 6 071	€ 2 708	€ 1 014
Actions émises en circulation	725	322	109
VNI par action	€ 8,38	€ 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	\$ 36 753	\$ 62 043	\$ 3 622
Actions émises en circulation	3 509	6 136	344
VNI par action	\$ 10,47	\$ 10,11	\$ 10,53
Distribution	\$ 556	\$ 418	S/O
Actions émises en circulation	59	45	S/O
VNI par action	\$ 9,45	\$ 9,34	S/O
Catégorie Z en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 10	€ 9	€ 10
Actions émises en circulation	1	1	1
VNI par action	€ 10,49	€ 10,21	€ 10,79
Fonds Low Duration Opportunities Fund			
Actif net	\$ 1 121 377	\$ 1 345 781	\$ 3 217 260
Institutions :			
Capitalisation	\$ 138 843	\$ 61 036	\$ 142 348
Actions émises en circulation	12 382	5 569	12 027
VNI par action	\$ 11,21	\$ 10,96	\$ 11,84

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)			
Distribution	\$ 25 000	\$ 33 224	\$ 41 508
Actions émises en circulation	2 637	3 555	4 051
VNI par action	\$ 9,48	\$ 9,35	\$ 10,25
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 16 304	€ 23 753	€ 41 652
Actions émises en circulation	1 682	2 478	3 940
VNI par action	€ 9,69	€ 9,58	€ 10,57
Distribution	€ 5 089	€ 10 599	€ 12 374
Actions émises en circulation	596	1 244	1 297
VNI par action	€ 8,54	€ 8,52	€ 9,54
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 497 866	£ 713 035	£ 1 734 093
Actions émises en circulation	47 643	69 498	155 485
VNI par action	£ 10,45	£ 10,26	£ 11,15
Distribution	£ 229 777	£ 288 970	£ 447 455
Actions émises en circulation	25 362	31 985	44 752
VNI par action	£ 9,06	£ 9,03	£ 10,00
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 4 060	€ 4 406	€ 8 109
Actions émises en circulation	442	485	806
VNI par action	€ 9,18	€ 9,09	€ 10,06
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 2 843	€ 3 102	€ 4 360
Actions émises en circulation	319	350	443
VNI par action	€ 8,93	€ 8,86	€ 9,84
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 1 573	\$ 1 534	\$ 2 989
Actions émises en circulation	166	166	301
VNI par action	\$ 9,48	\$ 9,24	\$ 9,93
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund			
Actif net	\$ 5 017	\$ 4 928	\$
Institutions :			
Capitalisation	\$ 4 491	\$ 4 426	S/O
Actions émises en circulation	447	446	S/O
VNI par action	\$ 10,05	\$ 9,90	S/O
Distribution	\$ 10	\$ 10	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	\$ 9,79	\$ 9,81	S/O
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 226	€ 225	S/O
Actions émises en circulation	23	23	S/O
VNI par action	€ 9,81	€ 9,78	S/O
Distribution	€ 9	€ 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	€ 9,56	€ 9,69	S/O
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 197	£ 194	S/O
Actions émises en circulation	20	20	S/O
VNI par action	£ 9,95	£ 9,85	S/O
Distribution	£ 8	£ 8	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	£ 9,66	£ 9,75	S/O
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund			
Actif net	\$ 97 091	\$ 120 137	\$ 100 538
Institutions :			
Capitalisation	\$ 13 729	\$ 21 492	\$ 21 487
Actions émises en circulation	1 297	2 114	2 658
VNI par action	\$ 10,59	\$ 10,17	\$ 8,08

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (suite)			
Distribution	\$ 8 590	\$ 10 469	\$ 29 680
Actions émises en circulation	1 348	1 678	5 697
VNI par action	\$ 6,37	\$ 6,24	\$ 5,21
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 36 472	€ 41 892	€ 19 141
Actions émises en circulation	4 102	4 844	2 714
VNI par action	€ 8,89	€ 8,65	€ 7,05
Distribution	€ 1 720	€ 3 309	€ 2 062
Actions émises en circulation	323	625	455
VNI par action	€ 5,33	€ 5,29	€ 4,54
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 1 460	£ 1 415	£ 1 362
Actions émises en circulation	161	162	193
VNI par action	£ 9,08	£ 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	\$ 21 107	\$ 23 893	\$ 10 905
Actions émises en circulation	3 670	4 223	2 287
VNI par action	\$ 5,75	\$ 5,66	\$ 4,77
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 10 141	\$ 14 340	\$ 11 293
Actions émises en circulation	752	1 113	1 113
VNI par action	\$ 13,48	\$ 12,88	\$ 10,14
Fonds Mortgage Opportunities Fund			
Actif net	\$ 620 336	\$ 849 148	\$ 2 238 424
Institutions :			
Capitalisation	\$ 314 026	\$ 409 011	\$ 558 563
Actions émises en circulation	28 587	38 104	47 581
VNI par action	\$ 10,98	\$ 10,73	\$ 11,74
Distribution	\$ 31 854	\$ 94 373	\$ 351 769
Actions émises en circulation	3 619	10 759	35 231
VNI par action	\$ 8,80	\$ 8,77	\$ 9,98
Institutions en CAD (couverte) :			
Capitalisation	CAD 23 924	CAD 23 438	CAD 25 659
Actions émises en circulation	2 532	2 532	2 532
VNI par action	CAD 9,45	CAD 9,26	CAD 10,14
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 2 590	CHF 3 010	CHF 5 577
Actions émises en circulation	277	322	532
VNI par action	CHF 9,36	CHF 9,34	CHF 10,47
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 119 415	€ 192 977	€ 317 357
Actions émises en circulation	12 364	20 209	29 769
VNI par action	€ 9,66	€ 9,55	€ 10,66
Distribution	€ 11 593	€ 14 970	€ 26 722
Actions émises en circulation	1 500	1 923	2 953
VNI par action	€ 7,73	€ 7,78	€ 9,05
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 6 109	£ 7 355	£ 19 288
Actions émises en circulation	592	727	1 733
VNI par action	£ 10,31	£ 10,12	£ 11,13
Distribution	£ 4 675	£ 6 104	£ 5 764
Actions émises en circulation	567	740	609
VNI par action	£ 8,24	£ 8,25	£ 9,46

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)			
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 21 447	\$ 20 219	\$ 32 611
Actions émises en circulation	2 038	1 963	2 885
VNI par action	\$ 10,52	\$ 10,30	\$ 11,30
Distribution	\$ 4 731	\$ 4 762	\$ 19 104
Actions émises en circulation	538	543	1 914
VNI par action	\$ 8,80	\$ 8,77	\$ 9,98
Administrations :			
Distribution	\$ 3 190	\$ 44	\$ 540
Actions émises en circulation	362	5	54
VNI par action	\$ 8,80	\$ 8,77	\$ 9,98
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 46 140	\$ 43 823	\$ 58 797
Actions émises en circulation	4 447	4 304	5 232
VNI par action	\$ 10,38	\$ 10,18	\$ 11,24
Distribution	\$ 6 086	\$ 4 351	\$ 10 154
Actions émises en circulation	692	496	1 017
VNI par action	\$ 8,79	\$ 8,77	\$ 9,99
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Distribution	CHF 228	CHF 166	CHF 319
Actions émises en circulation	31	22	36
VNI par action	CHF 7,43	CHF 7,55	CHF 8,82
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 13 696	€ 12 803	€ 16 220
Actions émises en circulation	1 503	1 415	1 591
VNI par action	€ 9,11	€ 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	\$ 40	\$ 39	\$ 71
Actions émises en circulation	4	4	7
VNI par action	\$ 10,11	\$ 9,88	\$ 10,83
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 10	\$ 10	\$ 214 716
Actions émises en circulation	1	1	19 628
VNI par action	\$ 10,04	\$ 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			
Actif net	\$ 1 803 959	\$ 1 008 739	\$ 3 761 156
Institutions :			
Capitalisation	\$ 1 141 405	\$ 581 668	\$ 2 349 757
Actions émises en circulation	20 867	12 422	39 164
VNI par action	\$ 54,70	\$ 46,83	\$ 60,00

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds StocksPLUS* Fund (suite)			
Distribution	\$ 28 551	\$ 24 829	\$ 39 901
Actions émises en circulation	735	734	913
VNI par action	\$ 38,84	\$ 33,81	\$ 43,69
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 106 679	€ 131 649	€ 570 050
Actions émises en circulation	3 479	4 953	16 237
VNI par action	€ 30,66	€ 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	£ 278	£ 3 922	£ 199
Actions émises en circulation	28	456	18
VNI par action	£ 9,98	£ 8,60	£ 11,28
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 437	SGD 335	S/O
Actions émises en circulation	43	38	S/O
VNI par action	SGD 10,18	SGD 8,76	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 29 245	\$ 19 778	\$ 21 609
Actions émises en circulation	581	458	389
VNI par action	\$ 50,34	\$ 43,17	\$ 55,51
BE Détail :			
Capitalisation	\$ 4 897	\$ 9	S/O
Actions émises en circulation	489	1	S/O
VNI par action	\$ 10,01	\$ 8,66	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 188 944	\$ 165 517	\$ 175 651
Actions émises en circulation	4 012	4 087	3 355
VNI par action	\$ 47,09	\$ 40,50	\$ 52,35
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 73 824	€ 35 366	€ 13 927
Actions émises en circulation	4 784	2 632	777
VNI par action	€ 15,43	€ 13,44	€ 17,91
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 213 312	\$ 33 724	\$ 504 831
Actions émises en circulation	15 626	2 884	33 635
VNI par action	\$ 13,65	\$ 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			
Actif net	\$ 11 547	\$ 9 528	\$ 11 610
Institutions :			
Capitalisation	\$ 10 552	\$ 9 327	\$ 10 848
Actions émises en circulation	640	663	603
VNI par action	\$ 16,49	\$ 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	£ 783	£ 167	£ 198
Actions émises en circulation	78	19	18
VNI par action	£ 10,02	£ 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

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
	Fonds Strategic Income Fund		
Actif net	\$ 461 936	\$ 506 557	\$ 619 928
Institutions :			
Capitalisation	\$ 20 699	\$ 21 761	\$ 33 080
Actions émises en circulation	1 783	1 939	2 754
VNI par action	\$ 11,61	\$ 11,22	\$ 12,01
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 150 032	€ 168 023	€ 207 426
Actions émises en circulation	11 466	13 134	14 906
VNI par action	€ 13,08	€ 12,79	€ 13,92
Institutions en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 207	£ 201	S/O
Actions émises en circulation	21	21	S/O
VNI par action	£ 9,69	£ 9,67	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 34 553	\$ 37 001	\$ 35 991
Actions émises en circulation	2 526	2 786	2 509
VNI par action	\$ 13,68	\$ 13,28	\$ 14,34
Distribution II	\$ 16 928	\$ 18 150	\$ 18 959
Actions émises en circulation	1 850	1 989	1 828
VNI par action	\$ 9,15	\$ 9,13	\$ 10,37
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 115 914	€ 133 817	€ 140 034
Actions émises en circulation	9 670	11 367	10 837
VNI par action	€ 11,99	€ 11,77	€ 12,92
Distribution II	€ 70 389	€ 76 984	€ 94 373
Actions émises en circulation	8 787	9 528	10 105
VNI par action	€ 8,01	€ 8,08	€ 9,34
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 14 079	€ 15 503	€ 17 708
Actions émises en circulation	1 319	1 475	1 529
VNI par action	€ 10,68	€ 10,51	€ 11,58
Distribution	€ 6 591	€ 8 019	€ 8 185
Actions émises en circulation	747	908	817
VNI par action	€ 8,83	€ 8,83	€ 10,02
	Fonds Total Return Bond Fund		
Actif net	\$ 4 326 369	\$ 4 150 717	\$ 4 944 898
Institutions :			
Capitalisation	\$ 1 531 261	\$ 1 419 973	\$ 1 598 195
Actions émises en circulation	51 909	49 161	46 882
VNI par action	\$ 29,50	\$ 28,88	\$ 34,09
Distribution	\$ 117 500	\$ 112 085	\$ 174 533
Actions émises en circulation	7 962	7 634	9 829
VNI par action	\$ 14,76	\$ 14,68	\$ 17,76
Institutions en CAD (couverte) :			
Distribution	CAD 9 498	CAD 13 555	CAD 26 323
Actions émises en circulation	1 110	1 587	2 540
VNI par action	CAD 8,56	CAD 8,54	CAD 10,36
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 3 894	CHF 3 138	CHF 13 206
Actions émises en circulation	398	320	1 111
VNI par action	CHF 9,79	CHF 9,79	CHF 11,88

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
	Fonds Total Return Bond Fund (suite)		
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 409 399	€ 388 231	€ 358 693
Actions émises en circulation	20 980	20 056	15 344
VNI par action	€ 19,51	€ 19,36	€ 23,38
Distribution	€ 208 583	€ 212 408	€ 260 110
Actions émises en circulation	17 935	18 120	17 931
VNI par action	€ 11,63	€ 11,72	€ 14,51
Institutions en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 8 546	€ 19 929	€ 14 618
Actions émises en circulation	316	736	488
VNI par action	€ 27,04	€ 27,06	€ 29,97
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 5 834	£ 3 621	£ 5 534
Actions émises en circulation	469	296	379
VNI par action	£ 12,44	£ 12,24	£ 14,59
Distribution	£ 20 149	£ 29 067	£ 43 763
Actions émises en circulation	2 455	3 543	4 355
VNI par action	£ 8,21	£ 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 7 447	SGD 7 941	SGD 21 940
Actions émises en circulation	603	652	1 524
VNI par action	SGD 12,35	SGD 12,17	SGD 14,40
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 374 957	\$ 409 533	\$ 369 122
Actions émises en circulation	13 866	15 440	11 750
VNI par action	\$ 27,04	\$ 26,52	\$ 31,41
Distribution	\$ 67 805	\$ 67 693	\$ 35 775
Actions émises en circulation	4 530	4 545	1 987
VNI par action	\$ 14,97	\$ 14,89	\$ 18,01
Investisseurs en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 2 805	CHF 2 893	CHF 4 784
Actions émises en circulation	299	307	417
VNI par action	CHF 9,39	CHF 9,41	CHF 11,46
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 17 802	€ 18 868	€ 19 262
Actions émises en circulation	973	1 038	874
VNI par action	€ 18,30	€ 18,18	€ 22,03
Administrations :			
Capitalisation	\$ 134 057	\$ 130 283	\$ 159 690
Actions émises en circulation	5 025	4 975	5 141
VNI par action	\$ 26,68	\$ 26,19	\$ 31,06
Distribution	\$ 50 367	\$ 4 583	S/O
Actions émises en circulation	5 268	482	S/O
VNI par action	\$ 9,56	\$ 9,51	S/O
Administrations en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 3 007	€ 2 966	€ 1 953
Actions émises en circulation	276	273	148
VNI par action	€ 10,91	€ 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 9,93	S/O	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 422 590	\$ 380 803	\$ 478 210
Actions émises en circulation	16 734	15 332	16 167
VNI par action	\$ 25,25	\$ 24,84	\$ 29,58
Distribution	\$ 149 005	\$ 151 164	\$ 199 962
Actions émises en circulation	13 266	13 526	14 801
VNI par action	\$ 11,23	\$ 11,18	\$ 13,51

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds Total Return Bond Fund (suite)			
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 11 034	CHF 9 731	CHF 5 648
Actions émises en circulation	1 329	1 166	553
VNI par action	CHF 8,30	CHF 8,34	CHF 10,22
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 452 255	€ 471 035	€ 623 265
Actions émises en circulation	27 052	28 276	30 705
VNI par action	€ 16,72	€ 16,66	€ 20,30
Distribution	€ 37 051	€ 40 476	€ 54 687
Actions émises en circulation	4 777	5 177	5 655
VNI par action	€ 7,76	€ 7,82	€ 9,67
Catégorie E en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 191	€ 489	€ 710
Actions émises en circulation	20	51	67
VNI par action	€ 9,48	€ 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 29 383	SGD 30 035	SGD 38 699
Actions émises en circulation	802	828	894
VNI par action	SGD 36,64	SGD 36,28	SGD 43,30
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 117 434	\$ 115 199	\$ 199 555
Actions émises en circulation	4 112	4 116	6 033
VNI par action	\$ 28,56	\$ 27,98	\$ 33,08
Distribution	\$ 9 231	\$ 8 589	\$ 17 255
Actions émises en circulation	1 020	954	1 585
VNI par action	\$ 9,05	\$ 9,00	\$ 10,89
M Détail en HKD (non couverte) :			
Distribution	HKD 82 672	HKD 76 242	HKD 91 252
Actions émises en circulation	9 270	8 622	8 552
VNI par action	HKD 8,92	HKD 8,84	HKD 10,67
Catégorie R en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 2 553	€ 2 836	€ 5 974
Actions émises en circulation	275	308	535
VNI par action	€ 9,28	€ 9,22	€ 11,16
Catégorie T :			
Capitalisation	\$ 6 107	\$ 6 382	\$ 13 697
Actions émises en circulation	615	652	1 172
VNI par action	\$ 9,93	\$ 9,79	\$ 11,69
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 4 745	€ 4 426	€ 4 561
Actions émises en circulation	555	518	437
VNI par action	€ 8,56	€ 8,54	€ 10,44
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund			
Actif net	\$ 302 364	\$ 435 924	\$ 101 789
Institutions :			
Capitalisation	\$ 98 805	\$ 183 555	\$ 70 982
Actions émises en circulation	7 881	14 361	6 152
VNI par action	\$ 12,54	\$ 12,78	\$ 11,54
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 32 375	€ 121 520	€ 11 436
Actions émises en circulation	2 955	10 765	1 108
VNI par action	€ 10,96	€ 11,29	€ 10,32
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 301	£ 9	S/O
Actions émises en circulation	31	1	S/O
VNI par action	£ 9,66	£ 9,88	S/O

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)			
Distribution	£ 66 524	£ 31 132	S/O
Actions émises en circulation	7 397	3 333	S/O
VNI par action	£ 8,99	£ 9,34	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	\$ 4 667	\$ 9	S/O
Actions émises en circulation	506	1	S/O
VNI par action	\$ 9,23	\$ 9,43	S/O
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 9	€ 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	€ 9,10	€ 9,39	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	\$ 9 234	\$ 11 079	\$ 2 886
Actions émises en circulation	804	941	269
VNI par action	\$ 11,49	\$ 11,78	\$ 10,74
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 15 563	€ 17 465	€ 1 747
Actions émises en circulation	1 551	1 680	182
VNI par action	€ 10,04	€ 10,40	€ 9,61
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 549	\$ 43	S/O
Actions émises en circulation	55	4	S/O
VNI par action	\$ 9,93	\$ 10,13	S/O
Catégorie Z :			
Capitalisation	\$ 51 840	\$ 55 435	\$ 12 929
Actions émises en circulation	4 695	4 958	1 299
VNI par action	\$ 11,04	\$ 11,18	\$ 9,95
Fonds UK Corporate Bond Fund			
Actif net	£ 334 835	£ 389 173	£ 592 164
Institutions :			
Capitalisation	£ 41 367	£ 46 355	£ 75 231
Actions émises en circulation	2 293	2 532	3 348
VNI par action	£ 18,04	£ 18,31	£ 22,47
Distribution	£ 228 419	£ 276 939	£ 436 466
Actions émises en circulation	28 029	32 956	41 393
VNI par action	£ 8,15	£ 8,40	£ 10,54
Catégorie Z :			
Capitalisation	£ 65 049	£ 65 879	£ 80 467
Actions émises en circulation	7 715	7 715	7 715
VNI par action	£ 8,43	£ 8,54	£ 10,43
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund			
Actif net	£ 297 912	£ 325 020	£ 425 748
Institutions :			
Capitalisation	£ 260 414	£ 283 958	£ 366 869
Actions émises en circulation	13 674	14 455	13 155
VNI par action	£ 19,04	£ 19,65	£ 27,89
Distribution	£ 37 498	£ 41 062	£ 58 879
Actions émises en circulation	3 516	3 656	3 578
VNI par action	£ 10,67	£ 11,23	£ 16,45
Fonds US High Yield Bond Fund			
Actif net	\$ 1 977 601	\$ 1 984 922	\$ 3 923 786
Institutions :			
Capitalisation	\$ 759 077	\$ 780 024	\$ 1 665 090
Actions émises en circulation	20 125	21 785	40 803
VNI par action	\$ 37,72	\$ 35,80	\$ 40,81
Distribution	\$ 210 079	\$ 233 780	\$ 400 716
Actions émises en circulation	24 484	27 877	39 668
VNI par action	\$ 8,58	\$ 8,39	\$ 10,10

Notes relatives aux États financiers (suite)

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021	
Fonds US High Yield Bond Fund (suite)				
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
Institutions en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 232 152	€ 240 268	€	482 095
Actions émises en circulation	8 184	8 811		15 170
VNI par action	€ 28,37	€ 27,27	€	31,78
Distribution	€ 35 376	€ 33 678	€	138 522
Actions émises en circulation	3 658	3 520		11 751
VNI par action	€ 9,67	€ 9,57	€	11,79
Institutions en GBP (couverte) :				
Capitalisation	£ 45 055	£ 40 143	£	48 533
Actions émises en circulation	2 048	1 913		2 009
VNI par action	£ 22,00	£ 20,99	£	24,16
Distribution	£ 2 131	£ 1 108	£	5 115
Actions émises en circulation	260	138		522
VNI par action	£ 8,18	£ 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	\$ 239 743	\$ 236 934	\$	434 782
Actions émises en circulation	7 133	7 413		11 894
VNI par action	\$ 33,61	\$ 31,96	\$	36,56
Distribution	\$ 20 137	\$ 20 862	\$	37 431
Actions émises en circulation	2 899	3 073		4 581
VNI par action	\$ 6,95	\$ 6,79	\$	8,17
Investisseurs en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 3 102	€ 2 708	€	3 173
Actions émises en circulation	121	110		110
VNI par action	€ 25,54	€ 24,59	€	28,78
Catégorie E :				
Capitalisation	\$ 128 310	\$ 132 559	\$	225 933
Actions émises en circulation	3 970	4 302		6 375
VNI par action	\$ 32,32	\$ 30,82	\$	35,44
Distribution	\$ 68 092	\$ 58 679	\$	124 742
Actions émises en circulation	7 436	6 557		11 581
VNI par action	\$ 9,16	\$ 8,95	\$	10,77
Catégorie E en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 54 724	€ 56 406	€	77 393
Actions émises en circulation	2 254	2 407		2 808
VNI par action	€ 24,27	€ 23,44	€	27,56
H Institutions :				
Capitalisation	\$ 108 402	\$ 88 253	\$	139 658
Actions émises en circulation	2 974	2 548		3 532
VNI par action	\$ 36,45	\$ 34,63	\$	39,54
Distribution	\$ 3 410	\$ 2 482	\$	3 370
Actions émises en circulation	402	299		337
VNI par action	\$ 8,49	\$ 8,29	\$	9,99
M Détail :				
Distribution	\$ 12 208	\$ 12 265	\$	4 154
Actions émises en circulation	1 315	1 351		381
VNI par action	\$ 9,28	\$ 9,08	\$	10,91
Catégorie R :				
Capitalisation	\$ 4 183	\$ 5 477	\$	4 914
Actions émises en circulation	281	387		304
VNI par action	\$ 14,90	\$ 14,17	\$	16,18

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021	
Fonds US High Yield Bond Fund (suite)				
Catégorie Z :				
Capitalisation	\$ 9 008	\$ 8 528	\$	9 666
Actions émises en circulation	661	661		661
VNI par action	\$ 13,63	\$ 12,91	\$	14,63
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund				
Actif net	\$ 444 793	\$ 388 522	\$	878 100
Institutions :				
Capitalisation	\$ 190 969	\$ 151 061	\$	132 646
Actions émises en circulation	17 423	14 307		10 461
VNI par action	\$ 10,96	\$ 10,56	\$	12,68
Distribution	\$ 68 975	\$ 61 577	\$	63 781
Actions émises en circulation	7 918	7 201		5 999
VNI par action	\$ 8,71	\$ 8,55	\$	10,63
Institutions en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 101 292	€ 124 155	€	214 560
Actions émises en circulation	10 706	13 447		18 908
VNI par action	€ 9,46	€ 9,23	€	11,35
Institutions en GBP (couverte) :				
Distribution II	£ 22 892	£ 13 692	£	304 200
Actions émises en circulation	2 968	1 794		31 489
VNI par action	£ 7,71	£ 7,63	£	9,66
Catégorie E :				
Capitalisation	\$ 37 293	\$ 21 852	\$	17 627
Actions émises en circulation	4 134	2 504		1 667
VNI par action	\$ 9,02	\$ 8,73	\$	10,58
Distribution	\$ 6 769	\$ 5 002	\$	8 025
Actions émises en circulation	765	576		743
VNI par action	\$ 8,85	\$ 8,68	\$	10,80
H Institutions :				
Capitalisation	\$ 1 173	\$ 55		S/O
Actions émises en circulation	116	6		S/O
VNI par action	\$ 10,09	\$ 9,73		S/O
Fonds US Short-Term Fund				
Actif net	\$ 2 066 904	\$ 2 310 115	\$	2 650 198
Institutions :				
Capitalisation	\$ 720 990	\$ 865 421	\$	835 096
Actions émises en circulation	61 864	76 197		73 558
VNI par action	\$ 11,65	\$ 11,36	\$	11,35
Distribution	\$ 121 354	\$ 131 027	\$	102 552
Actions émises en circulation	12 150	13 207		10 172
VNI par action	\$ 9,99	\$ 9,92	\$	10,08
Institutions en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 101 825	€ 202 833	€	233 199
Actions émises en circulation	10 126	20 470		23 092
VNI par action	€ 10,06	€ 9,91	€	10,10
Institutions en GBP (couverte) :				
Distribution	£ 201	S/O		S/O
Actions émises en circulation	20	S/O		S/O
VNI par action	£ 10,05	S/O		S/O
Investisseurs :				
Capitalisation	\$ 10 504	\$ 12 829	\$	18 474
Actions émises en circulation	930	1 164		1 671
VNI par action	\$ 11,29	\$ 11,02	\$	11,06
Catégorie E :				
Capitalisation	\$ 434 206	\$ 412 347	\$	467 026
Actions émises en circulation	38 580	37 521		42 334
VNI par action	\$ 11,25	\$ 10,99	\$	11,03
Catégorie E en EUR (couverte) :				
Capitalisation	€ 35 124	€ 44 471	€	9 227
Actions émises en circulation	3 631	4 656		944
VNI par action	€ 9,67	€ 9,55	€	9,77

	Au 30 juin 2023	Au 31 déc. 2022	Au 31 déc. 2021
Fonds US Short-Term Fund (suite)			
H Institutions :			
Capitalisation	\$ 17 510	\$ 22 367	\$ 33 914
Actions émises en circulation	1 639	2 147	3 250
VNI par action	\$ 10,68	\$ 10,42	\$ 10,44
Catégorie Z :			
Distribution	\$ 612 674	\$ 602 189	\$ 917 450
Actions émises en circulation	61 012	60 375	90 541
VNI par action	\$ 10,04	\$ 9,97	\$ 10,13

17. RÉMUNÉRATION

Le Gestionnaire applique une politique de rémunération conforme aux exigences relatives aux OPCVM et qui est résumée dans le Prospectus.

Les détails de la rémunération et des divulgations financières associées de la Société seront communiqués dans les États financiers annuels audités relatifs à l'exercice clos le 31 décembre 2023.

18. QUESTIONS RÉGLEMENTAIRES ET LITIGES

La Société n'est citée comme défendeur dans aucun litige ou procédure d'arbitrage important(e) et n'a pas connaissance d'un litige ou d'une réclamation important(e) effectué(e) ou n'en est pas menacée.

Ce qui précède ne s'applique qu'au 30 juin 2023.

19. FACILITÉ DE CRÉDIT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc, agissant pour le compte de chacun des Fonds Global High Yield Bond Fund et US High Yield Bond Fund (les « Fonds », individuellement un « Fonds ») a contracté une troisième facilité de crédit modifiée et mise à jour en date du 19 août 2022 (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 cette facilité à titre temporaire afin de financer les rachats aux actionnaires et à d'autres fins de liquidité à court terme visées dans sa politique d'investissement.

Sous réserve des conditions du Contrat de crédit, l'engagement total disponible et pouvant être utilisé par les Fonds est de 285 000 000 \$. 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 300 500 000 \$ (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 299 500 000 \$. 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 intégralement 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 intégralement 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 dans les 60 jours suivant son tirage.

Tous les prêts sont fournis sans garantie et le recours des Prêteurs à un Fonds est limité aux actifs de ce Fonds.

Au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022, aucun des Fonds n'avait effectué d'emprunt aux conditions du Contrat de crédit.

20. RÉGLEMENTATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT DE TITRES

La Réglementation relative aux opérations de financement de titres (« ROFT ») présente les obligations de reddition de compte et de communication relatives aux opérations de financement de titres (« OFT ») et aux 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/emprunt de titres ou de matières premières ;
- une opération d'achat suivie de revente ou de vente suivie d'un rachat dos-à-dos ; ou
- une opération de prêt avec appel de marge.

(a) Données mondiales et concentration des contreparties OFT

Au 30 juin 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 de financement par vente et rachat dos-à-dos

La juste valeur des actifs/(passifs) de toutes les OFT et de tous les swaps de rendement total au 30 juin 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).

	30 juin 2023	
	Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	\$ 7 016	0,25
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	\$ 347	0,11
Fonds PIMCO Capital Securities Fund		
Contrats de mise en pension		
NOM	\$ 25 100	0,46
Contrats de prise en pension		
BPS	(37 940)	(0,70)
BRC	(4 872)	(0,09)
JML	(117 913)	(2,16)
NOM	(4 768)	(0,09)
SCX	(87 890)	(1,61)
Total	(253 383)	(4,65)
Fonds PIMCO Climate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BOS	\$ 34 000	11,74
Fonds Commodity Real Return Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	\$ (3 069)	(0,31)
CBK	(4 652)	(0,49)
CIB	(818)	(0,08)
FBF	(380)	(0,04)
GST	(6 440)	(0,66)
JPM	(1 310)	(0,13)
MAC	(856)	(0,09)
MEI	(527)	(0,05)
SOG	(44)	0,00
Total	(18 096)	(1,85)

Notes relatives aux États financiers (suite)

	30 juin 2023	
	Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Commodity Real Return Fund (suite)		
Contrats de mise en pension		
FICC	\$ 2 394	0,25
Contrats de prise en pension		
BOS	(220 439)	(22,65)
GRE	(107 859)	(11,08)
IND	(10 956)	(1,13)
Total	(339 254)	(34,86)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BPG	(13 250)	(1,36)
TDM	(9 831)	(1,01)
Total	(23 081)	(2,37)
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	\$ 7	0,01
Contrats de mise en pension		
BPS	12 600	12,63
SSB	553	0,55
Total	13 153	13,18
Fonds Diversified Income Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	\$ 251 600	3,17
BRC	842 700	10,62
FICC	105 437	1,33
MBC	36 100	0,45
TDM	800	0,01
Total	1 236 637	15,58
Contrats de prise en pension		
BRC	(19 918)	(0,25)
JML	(26 154)	(0,33)
MYI	(17 123)	(0,22)
Total	(63 195)	(0,80)
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund		
Contrats de mise en pension		
BOS	\$ 91 100	17,47
BPS	13 000	2,49
FICC	3 266	0,63
Total	107 366	20,59
Contrats de prise en pension		
JML	(368)	(0,07)
Fonds Diversified Income ESG Fund		
Contrats de mise en pension		
MBC	\$ 7 400	12,76
Fonds Dynamic Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BRC	\$ 466 900	13,87
FICC	3 658	0,11
SAL	85 300	2,53
Total	555 858	16,51
Contrats de prise en pension		
BRC	(217)	(0,01)
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	€ (2 830)	(0,07)
Contrats de mise en pension		
BPS	73 200	1,72
FICC	16 166	0,38
IND	240 200	5,64
Total	329 566	7,74
Fonds Emerging Local Bond Fund		
Contrats de prise en pension		
BRC	\$ (73 428)	(2,63)
JML	(6 864)	(0,25)
MBC	(45 840)	(1,65)
SCX	(23 881)	(0,86)
Total	(150 013)	(5,39)

	30 juin 2023	
	Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Emerging Local Bond ESG Fund		
Contrats de prise en pension		
BPS	\$ (110)	(1,43)
Fonds Emerging Markets Bond Fund		
Contrats de prise en pension		
BPS	\$ (30 379)	(0,90)
BRC	(20 783)	(0,62)
MBC	(3 301)	(0,09)
NOM	(449)	(0,01)
Total	(54 912)	(1,62)
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	\$ 84 900	3,59
FICC	6 040	0,26
Total	90 940	3,85
Contrats de prise en pension		
BOS	(701)	(0,03)
BPS	(21 717)	(0,92)
BRC	(793)	(0,03)
MYI	(5 062)	(0,21)
NOM	(7 099)	(0,30)
SCX	(1 589)	(0,07)
Total	(36 961)	(1,56)
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	\$ 3 949	2,47
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	\$ 939	0,41
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	\$ 150	0,75
Fonds PIMCO ESG Income Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	\$ 31 800	12,49
Fonds Euro Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
COM	€ 101 800	5,81
FICC	2 444	0,14
Total	104 244	5,95
Fonds Euro Credit Fund		
Contrats de mise en pension		
COM	€ 27 600	4,53
FICC	977	0,16
Total	28 577	4,69
Contrats de prise en pension		
MYI	(549)	(0,09)
Fonds Euro Income Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
COM	€ 122 400	9,70
FICC	274	0,02
Total	122 674	9,72
Contrats de prise en pension		
MYI	(8 856)	(0,70)
Fonds Euro Long Average Duration Fund		
Contrats de mise en pension		
COM	€ 6 700	1,49
FICC	633	0,14
Total	7 333	1,63
Fonds Euro Short-Term Fund		
Contrats de mise en pension		
COM	€ 9 400	4,41
FICC	131	0,06
Total	9 531	4,47

	30 juin 2023	
	Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund		
Contrats de mise en pension BPS	€ 3 200	1,42
Contrats de prise en pension MYI	(837)	(0,37)
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension FICC	€ 295	0,20
Fonds Global Advantage Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 2 347	0,57
Fonds Global Bond Fund		
Contrats de mise en pension BPS	\$ 127 200	1,01
BRC	593 900	4,71
Total	721 100	5,72
Contrats de prise en pension MBC	(1 895)	(0,02)
Fonds Global Bond ESG Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 204 500	6,12
BPS	1 785	0,05
Total	206 285	6,17
Fonds Global Bond Ex-US Fund		
Swaps de rendement total BOA	\$ (18)	0,00
BPS	(146)	(0,02)
MYC	0	0,00
Total	(164)	(0,02)
Contrats de mise en pension FICC	1 874	0,26
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		
Swaps de rendement total BOA	\$ (970)	(0,14)
BPS	(208)	(0,03)
JPM	(989)	(0,15)
MBC	1 212	0,18
MYI	(53)	(0,01)
SOG	(650)	(0,10)
Total	(1 658)	(0,25)
Contrats de mise en pension FICC	18 513	2,77
Fonds Global High Yield Bond Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 3 895	0,13
Contrats de prise en pension BRC	(1 913)	(0,06)
JML	(6 473)	(0,22)
MYI	(3 599)	(0,11)
Total	(11 985)	(0,39)
Fonds Global Investment Grade Credit Fund		
Contrats de mise en pension BRC	\$ 472 200	4,50
FICC	79 332	0,75
SAL	8 000	0,08
Total	559 532	5,33
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund		
Contrats de mise en pension SSB	\$ 2 319	0,13
Contrats de prise en pension BOS	(151 412)	(8,32)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos BPG	(23 851)	(1,31)
MSC	(6 982)	(0,38)
Total	(30 833)	(1,69)

	30 juin 2023	
	Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Global Low Duration Real Return Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 7 529	0,60
Contrats de prise en pension BOS	(408 892)	(32,63)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos TDM	(9 212)	(0,74)
Fonds Global Real Return Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 2 272	0,09
Contrats de prise en pension BOS	(10 867)	(0,43)
BSN	(548 666)	(21,85)
CIB	(19 218)	(0,77)
GRE	(34 244)	(1,37)
NOM	(178 315)	(7,10)
Total	(791 310)	(31,52)
Fonds Income Fund		
Contrats de mise en pension BPS	\$ 877 858	1,37
BRC	417 900	0,65
FICC	122 098	0,19
MBC	558 100	0,86
NXN	105 100	0,16
SOG	9 545	0,01
Total	2 090 601	3,24
Contrats de prise en pension BRC	(5 159)	(0,01)
MBC	(3 161)	0,00
Total	(8 320)	(0,01)
Fonds Inflation Multi-Asset Fund		
Swaps de rendement total BPS	\$ 246	0,07
JPM	(78)	(0,02)
MAC	(421)	(0,13)
SOG	73	0,02
Total	(180)	(0,06)
Contrats de mise en pension BOS	3 300	1,02
SSB	801	0,25
Total	4 101	1,27
Fonds Low Average Duration Fund		
Contrats de prise en pension BOS	\$ (169 814)	(19,16)
GRE	(52 171)	(5,89)
Total	(221 985)	(25,05)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos BPG	(19 674)	(2,22)
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 563	0,07
Fonds Low Duration Income Fund		
Contrats de mise en pension BPS	\$ 322 600	22,16
FICC	3 892	0,27
Total	326 492	22,43
Fonds Low Duration Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension BPS	\$ 92 300	8,23
FICC	2 587	0,23
Total	94 887	8,46

Notes relatives aux États financiers (suite)

	30 juin 2023	
	Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Swaps de rendement total		
BOA	\$ 756	0,79
BPS	69	0,07
CBK	(9)	(0,01)
FAR	76	0,08
JPM	9	0,01
MYI	573	0,58
Total	1 474	1,52
Contrats de mise en pension SSB	840	0,87
Fonds Mortgage Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 4 008	0,65
Contrats de prise en pension BOS	(6 770)	(1,09)
CIB	(338 422)	(54,56)
Total	(345 192)	(55,65)
Fonds StocksPLUS™ Fund		
Swaps de rendement total		
CBK	\$ 375	0,02
FAR	6 677	0,37
JPM	11 224	0,62
RBC	26 283	1,46
UBS	1 397	0,08
Total	45 956	2,55
Contrats de mise en pension		
BPS	174 000	9,64
BRC	36 600	2,03
DEU	100	0,01
FICC	10 413	0,58
GSC	130 000	7,21
MFK	(150 000)	8,31
RVM	150 000	8,31
Total	651 113	36,09
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Swaps de rendement total		
BRC	\$ 62	0,53
CBK	94	0,82
FAR	133	1,15
RBC	315	2,73
Total	604	5,23
Contrats de mise en pension		
BPS	3 900	33,78
SSB	118	1,02
Total	4 018	34,80
Fonds Strategic Income Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 2 001	0,43
Fonds Total Return Bond Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 1 321	0,03
Contrats de prise en pension		
BRC	(8 309)	(0,19)
MYI	(1 098)	(0,03)
Total	(9 407)	(0,22)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BPG	(7 982)	(0,18)
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Swaps de rendement total MEI	\$ (232)	(0,08)
Contrats de mise en pension		
BPS	2 500	0,83
SSB	2 083	0,69
Total	4 583	1,52

	30 juin 2023	
	Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds UK Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BRC	£ 13 000	3,88
FICC	102	0,03
Total	13 102	3,91
Contrats de prise en pension SCX	(25 054)	(7,48)
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension FICC	£ 322	0,11
SCX	1 600	0,54
Total	1 922	0,65
Contrats de prise en pension SCX	(2 915)	(0,98)
Fonds US High Yield Bond Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 10 034	0,51
Contrats de prise en pension		
BOS	(3 139)	(0,16)
BRC	(1 740)	(0,09)
MYI	(1 060)	(0,05)
RDR	(3 547)	(0,18)
Total	(9 486)	(0,48)
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	\$ 22 300	5,01
FICC	2 968	0,67
Total	25 268	5,68
Fonds US Short-Term Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	\$ 225 700	10,93
FICC	2 237	0,11
Total	227 937	11,04

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 de financement par vente et rachat dos-à-dos

La juste valeur des actifs/(passifs) de toutes les OFT et de tous 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 Capital Securities Fund		
Contrats de mise en pension FICC	\$ 10 172	0,18
Contrats de prise en pension		
BPS	(71 348)	(1,25)
BRC	(4 860)	(0,08)
BYR	(59 977)	(1,05)
FBF	(2 857)	(0,05)
IND	(171 111)	(2,98)
JML	(135 138)	(2,36)
SCX	(133 184)	(2,34)
Total	(578 475)	(10,11)

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 PIMCO Climate Bond Fund			Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)		
Contrats de mise en pension			Contrats de mise en pension		
TDM	\$ 36 800	12,57	BPS	€ 22 818	0,45
Fonds Commodity Real Return Fund			CDI	100 000	1,96
Swaps de rendement total			FICC	1 786	0,03
BPS	\$ (2 955)	(0,21)	Total	124 604	2,44
CBK	(2 457)	(0,18)	Contrats de prise en pension		
CIB	(334)	(0,02)	BPS	(17 828)	(0,35)
FBF	(181)	(0,01)	Fonds Emerging Local Bond Fund		
GST	(3 476)	(0,25)	Contrats de prise en pension		
JPM	(345)	(0,03)	BPS	\$ (39 132)	(2,04)
MAC	1 137	0,08	BRC	(46 181)	(2,41)
MEI	(251)	(0,02)	Total	(85 313)	(4,45)
SOG	(497)	(0,04)	Fonds Emerging Markets Bond Fund		
Total	(9 359)	(0,68)	Contrats de mise en pension		
Contrats de mise en pension			FICC	\$ 9 160	0,28
FICC	613	0,04	Contrats de prise en pension		
IND	58 500	4,28	BPS	(36 659)	(1,11)
Total	59 113	4,32	BRC	(16 023)	(0,48)
Contrats de prise en pension			MBC	(1 622)	(0,05)
BOS	(485)	(0,04)	MEI	(21 052)	(0,64)
CIB	(331 976)	(24,23)	Total	(75 356)	(2,28)
GRE	(67 687)	(4,94)	Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund		
RCY	(25 154)	(1,84)	Contrats de mise en pension		
Total	(425 302)	(31,05)	FICC	\$ 9 261	0,37
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos			NOM	35 400	1,42
BOS	(17 959)	(1,31)	Total	44 661	1,79
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund			Contrats de prise en pension		
Swaps de rendement total			BPS	(21 023)	(0,84)
BPS	\$ (160)	(0,16)	BRC	(6 168)	(0,25)
Contrats de mise en pension			MEI	(4 460)	(0,18)
BPS	6 300	6,48	NOM	(7 189)	(0,29)
FICC	610	0,63	Total	(38 840)	(1,56)
Total	6 910	7,11	Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Fonds Diversified Income Fund			Contrats de mise en pension		
Contrats de mise en pension			BPS	\$ 6 100	3,61
BOS	\$ 500 000	5,71	FICC	2 286	1,35
BRC	568 200	6,49	Total	8 386	4,96
CIB	580 100	6,63	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
FICC	41 323	0,47	Contrats de mise en pension		
MBC	56 700	0,65	SSB	\$ 706	0,35
Total	1 746 323	19,95	Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Contrats de prise en pension			Contrats de mise en pension		
BRC	(4 363)	(0,05)	SAL	\$ 2 500	11,95
JML	(2 283)	(0,03)	SSB	266	1,27
Total	(6 646)	(0,08)	Total	2 766	13,22
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund			Fonds PIMCO ESG Income Fund		
Contrats de mise en pension			Contrats de mise en pension		
FICC	\$ 102 832	18,21	BPS	\$ 44 400	18,66
Fonds Dynamic Bond Fund			Fonds Euro Bond Fund		
Contrats de mise en pension			Contrats de mise en pension		
BRC	\$ 1 055 700	30,31	BPS	€ 10 900	0,57
FICC	2 892	0,08	FICC	615	0,03
SAL	87 100	2,50	Total	11 515	0,60
Total	1 145 692	32,89	Fonds Euro Credit Fund		
Contrats de prise en pension			Contrats de mise en pension		
DBL	(2 164)	(0,06)	BPS	€ 7 400	1,21
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund			FICC	921	0,15
Swaps de rendement total			IND	36 300	5,95
BPS	€ 440	0,01	Total	44 621	7,31
JPM	146	0,00	Fonds Euro Income Bond Fund		
MEI	80	0,00	Contrats de mise en pension		
Total	666	0,01	BPS	€ 16 600	1,23
			COM	100 000	7,38
			FICC	3 858	0,29
			Total	120 458	8,90

Notes relatives aux États financiers (suite)

Fonds	31 décembre 2022	
	Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
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 PIMCO Global Core Asset Allocation 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
Contrats de mise en pension		
BPS	7 300	0,97
FICC	11 236	1,50
Total	18 536	2,47
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	31 décembre 2022	
	Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Global Investment Grade Credit 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 Investment Grade Credit ESG Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	\$ 15 240	1,11
Contrats de prise en pension		
BOS	(75 130)	(5,48)
BRC	(798)	(0,06)
Total	(75 928)	(5,54)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BPG	(75 242)	(5,49)
MSC	(684)	(0,05)
Total	(75 926)	(5,54)
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 Inflation Multi-Asset Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	\$ (373)	(0,09)
BRC	(21)	(0,01)
CBK	(76)	(0,02)
GST	(118)	(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 (suite)			Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)		
JPM	\$ 17	0,00	UBS	\$ (35)	(0,01)
MAC	192	0,05	Total	(2 366)	(0,24)
MYI	(362)	(0,09)	Contrats de mise en pension		
SOG	(48)	(0,01)	BOS	20 300	2,01
Total	(789)	(0,20)	FICC	14 743	1,46
Contrats de mise en pension			NOM	60 000	5,95
GSC	37 700	9,34	SGY	24 500	2,43
SSB	3 020	0,76	TOR	36 902	3,67
Total	40 720	10,10	Total	156 445	15,52
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			BPS	1 200	12,59
dos-à-dos			SSB	174	1,83
CSN	(4 077)	(0,38)	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			FICC	144 795	3,49
dos-à-dos			Total	170 895	4,12
BPG	(1 409)	(0,22)	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		
GST	\$ (2)	0,00	dos-à-dos		
Contrats de mise en pension			BPG	(76 809)	(1,85)
FICC	5 431	0,50	Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
MBC	93 400	8,61	Swaps de rendement total		
Total	98 831	9,11	MEI	\$ (165)	(0,04)
Fonds Low Duration Opportunities Fund			Contrats de mise en pension		
Contrats de mise en pension			BPS	22 700	5,21
FICC	\$ 118 800	8,83	SSB	4 752	1,09
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund			Total	27 452	6,30
Swaps de rendement total			Fonds UK Corporate Bond Fund		
BOA	\$ (130)	(0,10)	Contrats de mise en pension		
CBK	(8)	(0,01)	FICC	£ 177	0,05
FAR	(18)	(0,01)	Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund		
JPM	(1)	0,00	Contrats de mise en pension		
MYI	16	0,01	FICC	£ 269	0,08
Total	(141)	(0,11)	Fonds US High Yield Bond Fund		
Contrats de mise en pension			Contrats de mise en pension		
SSB	811	0,68	FICC	\$ 9 269	0,47
Fonds Mortgage Opportunities Fund			Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension			Contrats de mise en pension		
BPS	\$ 13 700	1,61	BOS	\$ 12 800	3,30
FICC	3 618	0,43	FICC	2 583	0,66
Total	17 318	2,04	Total	15 383	3,96
Contrats de prise en pension			Opérations de financement par vente et rachat		
CIB	(264 111)	(31,10)	dos-à-dos		
JPS	(724)	(0,09)	BPG	(38 655)	(9,95)
RCY	(23 192)	(2,73)	Fonds US Short-Term Fund		
SCX	(28 466)	(3,35)	Contrats de mise en pension		
Total	(316 493)	(37,27)	FICC	\$ 154 472	6,69
Fonds StocksPLUS™ Fund					
Swaps de rendement total					
FAR	\$ (1 148)	(0,11)			
MBC	(120)	(0,01)			
RBC	(1 063)	(0,11)			

Notes relatives aux États financiers (suite)

(b) Garantie

(i) Garde des garanties reçues :

Les garanties reçues au 30 juin 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 30 juin 2023 sont les suivants. Si le nombre d'émetteurs est inférieur à dix, tous les émetteurs sont identifiés ci-dessous :

Fonds	Au 30 juin 2023	
	Émetteur de garantie	Juste valeur (en milliers)
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	\$ 7 156
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	354
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	Gouvernement des États-Unis	25 876
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	34 995
Fonds Commodity Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	2 442
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	13 433
Fonds Diversified Income Fund	Ginnie Mae	100 088
	Gouvernement des États-Unis	1 165 706
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Ginnie Mae	6 004
	Gouvernement des États-Unis	104 469
Fonds Diversified Income ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	7 643
Fonds Dynamic Bond Fund	Fannie Mae	395 977
	Ginnie Mae	83 801
	Gouvernement des États-Unis	90 822
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Agence Française de Développement	€ 6 042
	BNG Bank NV	2 220
	Bpifrance	798
	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	1 508
	Banque de développement du Conseil de l'Europe	2 300
	Union européenne	106 469
	Gouvernement français	28 465
	Gouvernement allemand	2 043
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	32 466
	La Poste S.A.	1 143
	Landwirtschaftliche Rentenbank	1 237
	Gouvernement luxembourgeois	50 663
	Nederlandse Waterschapsbank NV	1 634
	NRW Bank	600
	SFIL S.A.	174
	Société Nationale SNCF S.A.	73 831
	État de Berlin	3 312
	État de Basse-Saxe	197
	UNEDIC	4 648
	Gouvernement des États-Unis	16 489
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	\$ 27
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	92 751
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	4 028
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	958
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Gouvernement des États-Unis	153
Fonds PIMCO ESG Income Fund	Gouvernement des États-Unis	32 515
Fonds Euro Bond Fund	État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	€ 100 000
	État de la Sarre	8 561
	Gouvernement des États-Unis	2 493

Au 30 juin 2023

Fonds	Émetteur de garantie	Juste valeur (en milliers)
Fonds Euro Credit Fund	État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	€ 28 356
	Gouvernement des États-Unis	997
Fonds Euro Income Bond Fund	État de Brandenburg	100 000
	État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	32 863
	Gouvernement des États-Unis	280
Fonds Euro Long Average Duration Fund	État de Berlin	6 030
	Gouvernement des États-Unis	646
Fonds Euro Short-Term Fund	État de Brandenburg	9 724
	Gouvernement des États-Unis	134
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	Union européenne	3 250
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	301
Fonds Global Advantage Fund	Gouvernement des États-Unis	\$ 2 394
Fonds Global Bond Fund	Ginnie Mae	102
	Gouvernement des États-Unis	735 683
	Gouvernement des États-Unis	210 484
Fonds Global Bond ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	1 911
Fonds Global Bond Ex-US Fund	Gouvernement des États-Unis	18 883
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Gouvernement des États-Unis	3 973
Fonds Global High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	571 059
Global Investment Grade Credit Fund		
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	2 365
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	7 680
Fonds Global Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	2 317
Fonds Income Fund	American International Group, Inc.	3 115
	Amgen, Inc.	1 966
	Barclays PLC	3 300
	Obligation internationale du gouvernement canadien	225 563
	Morgan Stanley	1 791
	Province du Québec	161 448
	Gouvernement des États-Unis	1 744 640
	Gouvernement des États-Unis	4 206
Fonds Inflation Multi-Asset Fund		
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Gouvernement des États-Unis	574
Fonds Low Duration Income Fund	Ginnie Mae	48 032
	Gouvernement des États-Unis	285 568
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	96 812
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Gouvernement des États-Unis	857
Fonds Mortgage Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	4 088
Fonds StocksPLUS™ Fund	Fannie Mae	134 655
	Ginnie Mae	179 208
	Gouvernement des États-Unis	354 160
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Ginnie Mae	1 863
	Gouvernement des États-Unis	2 265
Fonds Strategic Income Fund	Gouvernement des États-Unis	2 041
Fonds Total Return Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	1 347
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Gouvernement des États-Unis	4 678
Fonds UK Corporate Bond Fund	Gouvernement du Royaume-Uni	£ 13 263
	Gouvernement des États-Unis	104
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	Gouvernement du Royaume-Uni	1 644
	Gouvernement des États-Unis	329
Fonds US High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	\$ 10 808
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	25 782
Fonds US Short-Term Fund	Gouvernement des États-Unis	232 988

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		Fonds	Au 31 décembre 2022	
	Émetteur de garantie	Juste valeur (en milliers)		Émetteur de garantie	Juste valeur (en milliers)
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	\$ 20 983	Fonds Euro Income Bond Fund	BNG Bank NV	€ 16 819
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	836		État de Berlin	102 209
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	Gouvernement des États-Unis	10 375		Gouvernement des États-Unis	3 935
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	38 412	Fonds Euro Long Average Duration Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	1 517
Fonds Commodity Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	61 286		BNG Bank NV	14 286
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	7 060	Fonds Euro Short-Term Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	3 743
Fonds Diversified Income Fund	Freddie Mac	139 541	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4 454
	Ginnie Mae	450 224	Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	\$ 1 436
	Gouvernement des États-Unis	1 205 939	Fonds Global Advantage Fund	Gouvernement des États-Unis	1 378 007
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Gouvernement des États-Unis	104 889	Fonds Global Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	1 181 854
Fonds Dynamic Bond Fund	Freddie Mac	139 541	Fonds Global Bond ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	1 658
	Ginnie Mae	413 154	Fonds Global Bond Ex-US Fund	Gouvernement des États-Unis	18 879
	Gouvernement des États-Unis	621 400	Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Gouvernement des États-Unis	11 642
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 100 270	Fonds Global High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	76 925
	Union européenne	18 150	Global Investment Grade Credit Fund	Gouvernement des États-Unis	15 545
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	161	Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	1 074
	Landwirtschaftliche Rentenbank	4 907	Fonds Global Low Duration Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	2 391
	Gouvernement des États-Unis	1 822	Fonds Global Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	3 498 550
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	\$ 9 343	Fonds Income Fund	Freddie Mac	38 846
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	45 570	Fonds Inflation Multi-Asset Fund	Gouvernement des États-Unis	3 080
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	8 567		Gouvernement des États-Unis	975
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	720	Fonds Low Average Duration Fund	Gouvernement des États-Unis	1 636
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Gouvernement des États-Unis	2 820	Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Gouvernement des États-Unis	101 947
Fonds PIMCO ESG Income Fund	Gouvernement des États-Unis	45 259	Fonds Low Duration Income Fund	Gouvernement des États-Unis	121 176
Fonds Euro Bond Fund	BNG Bank NV	€ 11 063	Fonds Low Duration Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	827
	Gouvernement des États-Unis	627	Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Gouvernement des États-Unis	36 902
Fonds Euro Credit Fund	BNG Bank NV	2 776	Fonds StocksPLUS™ Fund	Gouvernement canadien	122 051
	Bpifrance SACA	483		Gouvernement des États-Unis	1 405
	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	568	Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Gouvernement des États-Unis	797
	Union européenne	25 098	Fonds Strategic Income Fund	Gouvernement des États-Unis	174 491
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4 431	Fonds Total Return Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	28 016
	Landwirtschaftliche Rentenbank	8 536	Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Gouvernement des États-Unis	£ 181
	État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	837	Fonds UK Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	274
	UNEDIC	1 626	Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	\$ 9 454
	Gouvernement des États-Unis	940	Fonds US High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	15 768
			Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	157 561
			Fonds US Short-Term Fund	Gouvernement des États-Unis	

(iii) Données agrégées sur les transactions :

Les données agrégées sur les transactions correspondant aux positions de garantie (en numéraire notamment) reçues toutes OTF et tous swaps de rendement total confondu au 30 juin 2023 sont telles que suit :

Fonds	Type de valeur mobilière	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	\$ 7 156	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	354	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Trésor	25 876	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	790	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	7 750	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral

Notes relatives aux États financiers (suite)

Fonds	Type de valeur mobilière	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 Climate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Trésor	\$ 34 995	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Commodity Real Return Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	2 442	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	260	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	12 869	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	564	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Diversified Income Fund	Contrats de mise en pension	Ginnie Mae Obligations du Trésor américain	Mortgage Pass Thru Trésor	100 088 353 153	AAA AAA	Plus d'un an Plus d'un an	USD USD	Royaume-Uni Royaume-Uni	FED, bilatéral FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Trésor	1 640	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	255 041	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	447 505	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	108 367	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	288	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Ginnie Mae Obligations du Trésor américain	Mortgage Pass Thru Trésor	6 004 93 785	AAA AAA	Plus d'un an Plus d'un an	USD USD	France États-Unis	FED, bilatéral FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Trésor	102	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	7 251	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	3 331	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	7 643	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Dynamic Bond Fund	Contrats de mise en pension	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	395 977	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	83 801	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	90 822	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	€ 2 400	S/O	S/O	EUR	France	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Agence Française de Développement	Entreprises	697	AA	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral
		Agence Française de Développement	Entreprises	4 653	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Agence France Locale	Entreprises	692	A-	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		BNG Bank NV	Trésor	2 220	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Bpifrance Financement S.A.	Trésor	798	AA-	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Trésor	497	AA-	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Trésor	1 011	AA-	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Banque de développement du Conseil de l'Europe	Trésor	2 300	AA+	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Fonds européen de stabilité financière	Trésor	13 142	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Fonds européen de stabilité financière	Trésor	7 333	AAA	Moins d'un mois	EUR	France	FED, bilatéral
		Banque européenne d'investissement	Trésor	29 499	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Mécanisme européen de stabilité	Trésor	3 895	AAA	De 1 à 3 mois	EUR	France	FED, bilatéral
		Mécanisme européen de stabilité	Trésor	1 317	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Union européenne	Trésor	30 747	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Bons du Trésor de l'Union européenne	Trésor	9 739	AAA	De 1 à 3 mois	EUR	France	FED, bilatéral
		Bons du Trésor de l'Union européenne	Trésor	10 797	AAA	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral
		Obligation internationale du gouvernement français	Trésor	26 399	AA	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral
		Obligation internationale du gouvernement français	Trésor	2 066	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	1 364	AAA	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral

Fonds	Type de valeur mobilière	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
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	€ 31 102	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		La Poste S.A.	Entreprises	1 143	A+	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Land de Berlin	Trésor	3 312	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Trésor	1 237	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Obligation internationale du gouvernement luxembourgeois	Trésor	50 663	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Nederlandse Waterschapsbank NV	Trésor	1 634	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		NRW Bank	Entreprises	600	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		SFIL S.A.	Entreprises	174	AA-	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Société Nationale SNCF S.A.	Entreprises	73 831	A+	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		État de Basse-Saxe	Trésor	197	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	Trésor	396	AAA	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral
		État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	Trésor	1 647	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	16 489	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		UNEDIC	Trésor	4 648	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
Fonds Emerging Local Bond Fund	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	\$ 285	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Contrats de prise en pension	Obligations du Trésor américain	Trésor	27	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	86 590	AAA	3 mois - 1 an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	6 161	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	280	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	4 028	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	958	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	153	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO ESG Income Fund	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Trésor	24 760	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	7 755	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
Fonds Euro Bond Fund	Contrats de mise en pension	État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	Trésor	€ 100 000	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		État de la Sarre	Trésor	8 561	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	2 493	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Credit Fund	Contrats de mise en pension	État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	Trésor	28 356	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	997	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Income Bond Fund	Contrats de mise en pension	État de Brandenburg	Trésor	100 000	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	Trésor	32 863	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	280	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	270	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Euro Long Average Duration Fund	Contrats de mise en pension	Land de Berlin	Trésor	6 030	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	646	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Short-Term Fund	Contrats de mise en pension	État de Brandenburg	Trésor	9 724	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	134	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	Contrats de mise en pension	Union européenne	Trésor	3 250	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	301	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral

Notes relatives aux États financiers (suite)

Fonds	Type de valeur mobilière	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 Advantage Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	\$ 2 394	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Bond Fund	Contrats de mise en pension	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	102	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	129 709	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	605 974	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Global Bond ESG Fund	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Trésor	102	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	208 561	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	1 821	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Bond Ex-US Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	1 080	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	2 280	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	1 911	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	4 250	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	1 510	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	410	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	18 883	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global High Yield Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	3 973	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	481 979	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	89 080	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	2 365	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	7 680	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Real Return Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	2 317	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Income Fund	Contrats de mise en pension	American International Group, Inc.	Entreprises	3 115	BBB+	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Amgen, Inc.	Entreprises	1 966	BBB+	3 mois - 1 an	USD	France	FED, bilatéral
		Barclays PLC	Entreprises	3 300	A	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Obligation internationale du gouvernement canadien	Trésor	225 563	AA+	Plus d'un an	CAD	France	FED, bilatéral
		Morgan Stanley	Entreprises	1 791	A+	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Province du Québec	Trésor	161 448	AA-	Plus d'un an	CAD	France	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Trésor	144 409	AAA	De 1 à 3 mois	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Trésor	49 959	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Trésor	108 590	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Trésor	60 417	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	510 165	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	10 645	AAA	3 mois - 1 an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	735 915	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	124 540	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	1 340	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Trésor	3 389	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	817	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	574	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Low Duration Income Fund	Contrats de mise en pension	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	48 032	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	281 598	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	3 970	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	94 173	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	2 639	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	320	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	340	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	820	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	857	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Mortgage Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	4 088	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral

Fonds	Type de valeur mobilière	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 StocksPLUS™ Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	\$ 31 470	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	134 655	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	141 714	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
	Obligations du Trésor américain	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	37 494	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Trésor	Trésor	153 753	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Trésor	37 947	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	151 839	AAA	Plus d'un an	USD	Îles Caïmans	FED, bilatéral
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	300	S/O	S/O	USD	Canada	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	80	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	1 863	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	2 145	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
	Billets du Trésor américain	Trésor	120	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral	
		Billets du Trésor américain	Trésor	10 621	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Fonds Strategic Income Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	2 041	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis
Fonds Total Return Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	1 347	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	320	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	2 553	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	2 125	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	£ 104	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Bon du Trésor britannique	Trésor	13 263	AA-	Plus d'un an	GBP	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	329	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Bon du Trésor britannique	Trésor	1 644	AA-	Plus d'un an	GBP	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds US High Yield Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	\$ 10 235	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Obligations du Trésor américain	Trésor	303	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	270	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	22 755	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	3 027	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds US Short-Term Fund	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Trésor	200 759	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	29 947	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	2 282	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral

Les données agrégées sur les transactions correspondant aux positions de garantie (en numéraire notamment) reçues toutes OTF et tous swaps de rendement total confondus au 31 décembre 2022 sont telles que suit :

Fonds	Type de valeur mobilière	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 Capital Securities Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Trésor	10 375	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	3 516	S/O	S/O	USD	Canada	FED, bilatéral
	Contrats de prise 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
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	7 614	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Trésor	38 412	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Commodity Real Return Fund	Contrats de swap	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 mise en pension	Bons du Trésor américain	Trésor	625	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Trésor	60 504	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
Contrats de prise en pension	Obligations du Trésor américain	Trésor	157	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral	

Notes relatives aux États financiers (suite)

Fonds	Type de valeur mobilière	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	Bons du Trésor américain	Trésor	\$ 622	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	6 438	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
Fonds Diversified Income Fund	Contrats de mise en pension	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	139 541	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		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
		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
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	277	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Trésor	2 481	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Dynamic Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	102 408	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	139 541	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	413 154	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Trésor	2 950	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Trésor	529 681	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	88 769	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	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
	Contrats de mise en pension	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Trésor	100 270	AA	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral
		Mécanisme européen de stabilité	Trésor	18 150	AAA	De 1 à 3 mois	EUR	France	FED, bilatéral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	161	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Entreprises	4 907	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		
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	Garantie en numéraire	Liquidités	393	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		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
		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
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	720	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	2 549	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	271	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	45 259	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
Fonds Euro Credit Fund	Contrats de mise en pension	BNG Bank NV	Trésor	€ 11 063	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	627	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		BNG Bank NV	Trésor	2 776	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Bpifrance SACA	Trésor	483	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Trésor	568	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Banque de développement du Conseil de l'Europe	Trésor	784	AA+	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Mécanisme européen de stabilité	Trésor	4 996	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Banque européenne d'investissement	Trésor	6 798	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral

Fonds	Type de valeur mobilière	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
		Union européenne	Trésor	€ 12 520	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	979	AAA	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	3 452	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Entreprises	8 536	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	Trésor	837	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		UNEDIC	Trésor	1 626	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Trésor	940	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Income Bond Fund	Contrats de mise en pension	BNG Bank NV	Trésor	16 819	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		État de Berlin	Trésor	102 209	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Trésor	3 935	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Long Average Duration Fund	Contrats de mise en pension	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	1 517	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
Fonds Euro Short-Term Fund	Contrats de mise en pension	BNG Bank NV	Trésor	14 286	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	Contrats de mise en pension	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	3 743	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	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
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Trésor	269 857	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	674 208	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	126 755	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
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
		Billets du Trésor américain	Trésor	543 261	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	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 PIMCO Global Core Asset Allocation 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
	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
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
		Obligations du Trésor américain	Trésor	3 674	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	205	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Global Investment Grade Credit Fund	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
		Billets du Trésor américain	Trésor	15 695	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	Contrats de mise en pension	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
		Obligations du Trésor américain	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
		Obligations du Trésor américain	Trésor	1	AAA	Plus d'un an	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

Notes relatives aux États financiers (suite)

Fonds	Type de valeur mobilière	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 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
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
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	4 656	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds StocksPLUS™ Fund	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
		Obligations du Trésor américain	Trésor	107 013	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Trésor	1 227	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Trésor	178	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	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 30 juin 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 de contrats de swap et le montant total des garanties pour ces accords est indiqué ci-dessus.

(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 périodes closes le 30 juin 2023 et le 30 juin 2022. Les montants sont présentés dans la devise de référence des Fonds.

Fonds	30 juin 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	\$ 733	\$ 0	\$ 0	\$ (61)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	22	0	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	1 818	0	133	(8 854)	0	0	0	0
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	1 017	0	1	(4)	0	0	0	0
Fonds Commodity Real Return Fund	229	0	0	(9 180)	0	(2)	0	(64)
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	282	0	0	0	0	0	0	(1)
Fonds Diversified Income Fund	30 043	0	0	(330)	0	0	0	0
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	2 075	0	0	(1)	0	0	0	0
Fonds Diversified Income ESG Fund	62	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Dynamic Bond Fund	15 666	0	0	0	0	0	0	0

Une partie des garanties indiquées se rapporte à des produits dérivés qui ne relèvent pas du champ de la ROFT.

(iv) Données sur la réutilisation des garanties :

Les titres reçus à titre de garantie ne sont pas réutilisés au 30 juin 2023 ou au 31 décembre 2022.

Les garanties reçues aux 30 juin 2023 et 31 décembre 2022 étaient détenues au sein du réseau de dépositaires de State Street Bank and Trust.

(v) Garde des garanties données :

Les garanties nanties par les Fonds au 30 juin 2023 et au 31 décembre 2022 sont détenues par les contreparties sur des comptes autres que des comptes regroupés ou séparés.

30 juin 2023

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 Dynamic Multi-Asset Fund	€ 2 823	€ 0	€ 0	€ (6)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Fonds Emerging Local Bond Fund	\$ 304	\$ 0	\$ 0	\$ (4 900)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Fonds Emerging Local Bond ESG Fund	0	0	0	(3)	0	0	0	0
Fonds Emerging Markets Bond Fund	71	0	0	(2 061)	0	0	0	(170)
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	1 572	0	0	(900)	0	0	0	(6)
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	39	0	0	(2)	0	0	0	0
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	173	0	0	(14)	0	0	0	0
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	136	0	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO ESG Income Fund	1 138	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Euro Bond Fund	€ 1 126	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Fonds Euro Credit Fund	364	0	0	(4)	0	0	0	0
Fonds Euro Income Bond Fund	1 277	0	0	(15)	0	0	0	0
Fonds Euro Long Average Duration Fund	65	0	0	(13)	0	0	0	0
Fonds Euro Short-Term Fund	186	0	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	125	0	0	(2)	0	0	0	0
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	42	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Global Advantage Fund	\$ 20	\$ 0	\$ 0	\$ (7)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1)
Fonds Global Bond Fund	14 063	0	0	(10)	0	0	0	(20)
Fonds Global Bond ESG Fund	10 397	0	1	(13)	0	0	0	(5)
Fonds Global Bond Ex-US Fund	21	0	0	(8)	0	0	0	(3)
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	443	0	0	(28)	0	0	0	(32)
Fonds Global High Yield Bond Fund	285	0	35	0	0	0	0	(6)
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	11 884	(89)	0	(16)	0	0	0	0
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	200	0	0	(2 757)	0	0	0	(372)
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	27	0	0	(8 191)	0	0	0	(303)
Fonds Global Real Return Fund	33	0	0	(19 043)	0	0	0	(185)
Fonds Income Fund	155 272	0	5	(39)	0	0	0	(89)
Fonds Income Fund II	0	(51)	0	0	0	0	0	(20)
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	409	0	0	0	0	0	0	(5)
Fonds Low Average Duration Fund	269	0	13	(2 221)	0	(1)	0	(889)
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	45	0	0	(178)	0	0	0	(264)
Fonds Low Duration Income Fund	5 404	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Low Duration Opportunities Fund	1 654	0	0	(51)	0	0	0	0
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	12	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Mortgage Opportunities Fund	589	0	0	(7 156)	0	0	0	(7)
Fonds StocksPLUS™ Fund	10 986	0	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	60	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Strategic Income Fund	16	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Total Return Bond Fund	378	0	0	(37)	0	0	0	(8)
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	402	0	0	(9)	0	0	0	(17)
Fonds UK Corporate Bond Fund	£ 93	£ 0	£ 0	£ (286)	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	19	0	0	(117)	0	0	0	0
Fonds US High Yield Bond Fund	\$ 145	\$ 0	\$ 16	\$ (2)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (19)
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	431	0	0	0	0	0	1	0
Fonds US Short-Term Fund	1 618	0	0	(4)	0	0	0	(140)

30 juin 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	\$ 60	\$ 0	\$ 505	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	4	0	35	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	65	0	309	1 383	0	0	0	0
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	6	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Commodity Real Return Fund	58	0	0	18	0	0	0	80
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	2	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Diversified Income Fund	1 661	0	2 118	0	0	0	0	0
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	114	0	57	0	0	0	0	0
Fonds Dynamic Bond Fund	48	0	39	0	0	0	0	0
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	€ 7	€ 619	€ 13	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0

30 juin 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 Emerging Local Bond Fund	\$ 3	\$ 0	\$ 0	\$ 3 248	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Fonds Emerging Markets Bond Fund	51	0	78	250	0	0	0	0
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	70	0	137	196	0	0	0	0
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	1	0	1	2	0	0	0	0
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	64	9	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO ESG Income Fund	20	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Euro Bond Fund	€ 0	€ 100	€ 14	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Fonds Euro Credit Fund	2	63	4	0	0	0	0	0
Fonds Euro Income Bond Fund	0	99	38	0	0	0	0	0
Fonds Euro Long Average Duration Fund	0	8	0	0	0	0	0	0
Fonds Euro Short-Term Fund	0	51	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	0	25	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	\$ 0	\$ 0	\$ 120	\$ 29	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 8
Fonds Global Bond Fund	557	0	2 813	229	0	0	0	20
Fonds Global Bond ESG Fund	231	0	0	6	0	0	0	1
Fonds Global Bond Ex-US Fund	1	0	293	31	0	0	0	0
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	6	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Global High Yield Bond Fund	134	0	169	28	0	0	0	0
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	28	0	29	103	0	0	0	7
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	29	0	0	77	0	0	0	31
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	1	0	0	0	0	0	0	465
Fonds Global Real Return Fund	17	0	56	1 862	0	0	0	96
Fonds Income Fund	10 275	70	1 605	0	0	0	0	6
Fonds Income Fund II	2	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	121	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Low Average Duration Fund	117	0	0	3	0	0	204	0
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	4	0	0	0	0	0	20	0
Fonds Low Duration Income Fund	66	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Low Duration Opportunities Fund	458	0	7	0	0	0	0	0
Fonds Mortgage Opportunities Fund	1	0	0	701	0	0	0	7
Fonds StocksPLUS™ Fund	310	0	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	3	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Strategic Income Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Total Return Bond Fund	122	0	19	380	0	0	0	31
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	9	0	0	0	0	0	0	0
Fonds UK Corporate Bond Fund	£ 137	£ 0	£ 0	£ 114	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	17	0	0	37	0	0	0	0
Fonds US High Yield Bond Fund	\$ 83	\$ 0	\$ 17	\$ 33	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	0	0	0	8	0	0	0	11
Fonds US Short-Term Fund	5	0	0	435	0	0	0	192

Tous les rendements des opérations sur produits 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 la période, 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.

21. ÉVÉNEMENTS IMPORTANTS

En février 2022, la Russie a lancé une invasion de l'Ukraine, entraînant des sanctions imposées à diverses entités et personnes russes. Les Fonds peuvent investir dans des titres et instruments qui sont économiquement liés à la Russie. Ces investissements peuvent avoir été affectés négativement par les sanctions et les contre-sanctions imposées par la Russie,

engendrant notamment une baisse de valeur et de liquidité. La réduction de la liquidité des investissements liés à la Russie 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 liés à la Russie 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.

Aucun autre événement important n'est intervenu au cours de la période.

22. ÉVÉNEMENTS POSTÉRIEURS

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 à PIMCO Asia High Yield Bond Fund. À la date du 25 août 2023, aucun fonds n'a contracté d'emprunts en vertu de l'accord de facilité de crédit. De plus amples informations seront fournies dans les États financiers annuels vérifiés pour l'exercice clos le 31 décembre 2023.

Aucun autre événement important ne s'est produit après la clôture de la période.

23. APPROBATION DES ÉTATS FINANCIERS

Les états financiers ont été approuvés le 25 août 2023 par le Conseil d'administration.

Variations importantes de la composition du portefeuille Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund

30 juin 2023

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU' AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU' AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	41 324 787	\$ 411 499	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	38 107 620	\$ 379 478
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Standard Chartered PLC 7,750 % éch. 15/08/2027	\$ 40 400	40 538	Sands China Ltd. 5,625 % éch. 08/08/2025	\$ 26 900	26 621
Obligation internationale du gouvernement mongol 8,650 % éch. 19/01/2028	28 270	27 934	Freeport Indonesia PT 5,315 % éch. 14/04/2032	21 800	20 424
Shriram Finance Ltd. 4,400 % éch. 13/03/2024	25 154	24 632	Muthoot Finance Ltd. 4,400 % éch. 02/09/2023	19 800	19 483
Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 3,250 % éch. 05/05/2026	32 250	24 086	Krung Thai Bank PCL 4,400 % éch. 25/03/2026	18 800	17 128
Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,650 % éch. 20/09/2032	21 684	21 457	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % éch. 29/07/2026	15 800	14 868
Bangkok Bank PCL 5,000 % éch. 23/09/2025	18 400	17 447	Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % éch. 20/05/2026	16 800	14 867
Huarong Finance Co. Ltd. 4,750 % éch. 27/04/2027	18 100	15 569	India Green Power Holdings 4,000 % éch. 22/02/2027	16 600	14 360
SK Hynix, Inc. 6,375 % éch. 17/01/2028	15 200	15 126	NWD Finance BVI Ltd. 5,250 % éch. 22/03/2026	16 200	13 870
Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 2,700 % éch. 13/01/2025	21 200	15 109	NWD Finance BVI Ltd. 4,800 % éch. 09/09/2023	17 200	12 468
Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % éch. 19/08/2025	15 600	14 077	Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % éch. 22/10/2025	12 400	12 277
Wanda Properties Global Co. Ltd. 11,000 % éch. 20/01/2025	14 000	13 668	HSBC Holdings PLC 6,000 % éch. 22/05/2027	12 700	12 171
ReNew Wind Energy AP2 4,500 % éch. 14/07/2028	15 800	13 431	NWD Finance BVI Ltd. 6,150 % éch. 16/03/2025	11 300	10 525
Standard Chartered PLC 6,000 % éch. 26/07/2025	13 400	13 200	SK Hynix, Inc. 6,375 % éch. 17/01/2028	10 300	10 482
Adaro Indonesia PT 4,250 % éch. 31/10/2024	13 590	13 133	Lenovo Group Ltd. 5,875 % éch. 24/04/2025	10 000	10 024
Wynn Macau Ltd. 4,500 % éch. 07/03/2029	12 300	13 029	Obligation internationale du gouvernement mongol 5,625 % éch. 01/05/2023	10 022	9 972
Huarong Finance Co. Ltd. 3,250 % éch. 13/11/2024	13 900	12 967	Zhongsheng Group Holdings Ltd. 0,000 % éch. 21/05/2025	HKD 69 000	9 705
Huarong Finance Co. Ltd. 3,750 % éch. 29/05/2024	13 500	12 925	Standard Chartered PLC 7,750 % éch. 15/08/2027	\$ 9 400	9 230
SK Broadband Co. Ltd. 4,875 % éch. 28/06/2028	12 950	12 856	Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % éch. 29/05/2029	10 700	9 202
Huarong Finance Co. Ltd. 5,000 % éch. 19/11/2025	13 100	11 595	Freeport Indonesia PT 4,763 % éch. 14/04/2027	9 200	8 855
Sands China Ltd. 5,900 % éch. 08/08/2028	11 700	11 346			
Agile Group Holdings Ltd. 5,500 % éch. 17/05/2026	27 010	11 343			
Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % éch. 29/05/2029	14 300	11 201			

(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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8 563 541	\$ 85 277	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	9 459 862	\$ 94 200
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Korea Housing Finance Corp. 4,625 % éch. 24/02/2028	\$ 7 100	7 039	Korea National Oil Corp. 2,125 % éch. 18/04/2027	\$ 5 300	4 808
Kasikornbank PCL 5,458 % éch. 07/03/2028	5 600	5 600	ONGC Videsh Ltd. 3,750 % éch. 07/05/2023	4 100	4 082
POSCO 5,750 % éch. 17/01/2028	3 700	3 682	Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,650 % éch. 20/09/2032	4 000	3 944
Export-Import Bank of Korea 5,000 % éch. 11/01/2028	3 500	3 520	Export-Import Bank of Korea 5,000 % éch. 11/01/2028	3 500	3 573
Korea National Oil Corp. 4,875 % éch. 03/04/2028	3 500	3 506	Periama Holdings LLC 5,950 % éch. 19/04/2026	3 500	3 378
SK Hynix, Inc. 2,375 % éch. 19/01/2031	4 620	3 477	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,400 % éch. 06/06/2027	3 200	3 165
SMBC Aviation Capital Finance DAC 5,450 % éch. 03/05/2028	3 400	3 401	Kasikornbank PCL 5,458 % éch. 07/03/2028	2 900	2 995
SK on Co. Ltd. 5,375 % éch. 11/05/2026	3 400	3 397	SK Hynix, Inc. 2,375 % éch. 19/01/2031	3 600	2 730
Bank Mandiri Persero Tbk PT 5,500 % éch. 04/04/2026	2 900	2 888	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 4,250 % éch. 12/09/2028	2 300	2 250
India Toll Roads 5,500 % éch. 19/08/2024	2 700	2 594	Muang Thai Life Assurance PCL 3,552 % éch. 27/01/2037	2 600	2 249
NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % éch. 10/03/2028	3 550	2 523	SK Hynix, Inc. 6,375 % éch. 17/01/2028	2 200	2 209
Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp. 5,375 % éch. 11/05/2028	2 450	2 431	Celestial Miles Ltd. 5,750 % éch. 31/01/2024	2 200	2 175
Standard Chartered PLC 6,301 % éch. 09/01/2029	2 300	2 303	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % éch. 24/04/2033	2 189	2 160
Woori Bank 4,875 % éch. 26/01/2028	2 200	2 192	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 4,250 % éch. 19/06/2024	2 100	2 079
SK Hynix, Inc. 6,375 % éch. 17/01/2028	2 200	2 189	Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. 4,250 % éch. 27/07/2027	2 000	1 939
Standard Chartered PLC 7,750 % éch. 15/08/2027	2 100	2 110	Adaro Indonesia PT 4,250 % éch. 31/10/2024	1 900	1 834
Obligation internationale du gouvernement vietnamien 5,500 % éch. 12/03/2028	2 000	1 940	LG Chem Ltd. 2,375 % éch. 07/07/2023	2 000	1 652
Adaro Indonesia PT 4,250 % éch. 31/10/2024	1 900	1 834	GC Treasury Center Co. Ltd. 2,980 % éch. 18/03/2031	1 900	1 544
Melco Resorts Finance Ltd. 5,750 % éch. 21/07/2028	2 100	1 759	Wynn Macau Ltd. 5,500 % éch. 15/01/2026	1 600	1 465

(a) Le Fonds Asia Strategic Interest 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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Crédit Agricole S.A. 7,250 % éch. 23/09/2028	€ 117 500	\$ 125 610	HSBC Holdings PLC 4,750 % éch. 04/07/2029	€ 83 102	\$ 78 626
Lloyds Banking Group PLC 8,500 % éch. 27/03/2028	£ 54 000	66 135	BNP Paribas S.A. 7,000 % éch. 16/08/2028	\$ 56 700	55 964
Barclays PLC 9,250 % éch. 15/09/2028	49 500	59 529	CaixaBank S.A. 5,250 % éch. 23/03/2026	€ 54 000	51 184
ING Groep NV 7,500 % éch. 16/05/2028	\$ 56 400	55 970	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % éch. 11/01/2027	45 300	47 981
HSBC Holdings PLC 8,000 % éch. 07/03/2028	54 700	54 194	Société Générale S.A. 6,221 % éch. 15/06/2033	\$ 49 800	47 552
Intesa Sanpaolo SpA 7,778 % éch. 20/06/2054	48 400	48 400	Barclays PLC 8,875 % éch. 15/09/2027	£ 36 200	40 562
Deutsche Bank AG 7,079 % éch. 10/02/2034	46 371	46 326	Société Générale S.A. 6,750 % éch. 06/04/2028	\$ 44 300	38 270
Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % éch. 24/06/2024	£ 36 675	42 698	Deutsche Bank AG 3,742 % éch. 07/01/2033	49 100	38 161
HSBC Holdings PLC 6,000 % éch. 29/09/2023	€ 36 831	39 440	RCI Banque S.A. 2,625 % éch. 18/02/2030	€ 36 500	36 562
Lloyds Banking Group PLC 8,000 % éch. 27/09/2029	\$ 43 280	37 626	ING Groep NV 5,750 % éch. 16/11/2026	\$ 39 300	35 228
Svenska Handelsbanken AB 4,375 % éch. 01/03/2027	44 600	37 295	Barclays PLC 8,000 % éch. 15/03/2029	40 000	34 259
Société Générale S.A. 6,691 % éch. 10/01/2034	36 200	37 133	Barclays PLC 9,250 % éch. 15/09/2028	£ 30 000	33 921
CaixaBank S.A. 8,250 % éch. 13/03/2029	€ 29 600	31 588	Barclays PLC 6,375 % éch. 15/12/2025	30 764	32 967
Svenska Handelsbanken AB 4,750 % éch. 01/03/2031	\$ 35 800	29 312	Électricité de France S.A. 6,125 % éch. 15/12/2026	€ 33 600	30 259
Électricité de France S.A. 9,125 % éch. 15/03/2033	23 800	24 201	Abertis Infraestructuras Finance BV 2,625 % éch. 26/01/2027	35 800	30 190
Société Générale S.A. 7,875 % éch. 18/12/2023	23 600	23 549	Deutsche Bank AG 4,500 % éch. 30/11/2026	39 400	30 073
Morgan Stanley 5,948 % éch. 19/01/2038	23 400	23 400	Barclays PLC 6,125 % éch. 15/12/2025	\$ 35 300	29 859
Barclays PLC 8,000 % éch. 15/06/2024	23 350	23 199	BNP Paribas S.A. 6,875 % éch. 06/12/2029	€ 27 400	28 694
BNP Paribas S.A. 7,375 % éch. 11/06/2030	€ 21 800	23 162	BNP Paribas S.A. 9,250 % éch. 17/11/2027	\$ 24 300	26 298
NatWest Group PLC 6,000 % éch. 29/12/2025	\$ 24 300	22 097	UBS Group AG 4,194 % éch. 01/04/2031	32 900	26 172
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 8,375 % éch. 21/06/2028	€ 20 200	21 821	Legal & General Group PLC 5,625 % éch. 24/03/2031	£ 26 300	26 142
Société Générale S.A. 7,875 % éch. 18/12/2023	19 400	20 862	UBS Group AG 7,000 % éch. 31/01/2024	\$ 24 958	24 958
HSBC Holdings PLC 6,161 % éch. 09/03/2029	\$ 20 000	20 000	NatWest Group PLC 7,416 % éch. 06/06/2033	£ 17 500	22 490
NatWest Group PLC 4,600 % éch. 28/06/2031	25 000	19 679	Erste Group Bank AG 4,250 % éch. 15/10/2027	€ 26 800	22 307
BNP Paribas S.A. 9,250 % éch. 17/11/2027	18 000	19 404	Banco Mercantil del Norte S.A. 8,375 % éch. 14/10/2030	\$ 23 900	21 730
BNP Paribas S.A. 7,750 % éch. 16/08/2029	19 665	19 238	Deutsche Bank AG 7,079 % éch. 10/02/2034	23 186	21 308
HSBC Holdings PLC 6,000 % éch. 22/05/2027	19 300	17 225	Lloyds Banking Group PLC 8,500 % éch. 27/03/2028	£ 18 100	21 144
Crédit Agricole S.A. 7,875 % éch. 23/01/2024	17 200	17 137	UBS Group AG 4,375 % éch. 10/02/2031	\$ 25 200	20 339
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % éch. 21/11/2033	16 000	16 511	Deutsche Bank AG 3,729 % éch. 14/01/2032	26 875	20 232
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % éch. 18/07/2033	16 200	16 200	NatWest Group PLC 4,600 % éch. 28/06/2031	27 100	19 749
Lloyds Banking Group PLC 7,875 % éch. 27/06/2029	£ 14 041	16 183	Swedbank AB 4,000 % éch. 17/03/2029	26 000	19 284
de Volksbank NV 7,000 % éch. 15/12/2027	€ 16 000	16 129	HSBC Holdings PLC 8,000 % éch. 07/03/2028	19 300	19 141
Deutsche Bank AG 5,000 % éch. 05/09/2030	15 800	15 913			
Lloyds Banking Group PLC 7,500 % éch. 27/06/2024	\$ 15 800	15 682			
ING Groep NV 3,875 % éch. 16/05/2027	22 158	15 644			
Lloyds Banking Group PLC 4,947 % éch. 27/06/2025	€ 14 982	15 384			

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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Banque européenne d'investissement 3,750 % éch. 14/02/2033	\$ 5 000	\$ 4 974	Billets du Trésor américain 0,375 % éch. 30/11/2025	\$ 7 490	\$ 6 751
Caja Rural de Navarra SCC 3,000 % éch. 26/04/2027	€ 2 100	2 271	Billets du Trésor américain 1,125 % éch. 15/01/2025	3 600	3 378
Nordea Bank Abp 6,000 % éch. 02/06/2026	£ 1 800	2 236	Dominion Energy, Inc. 2,250 % éch. 15/08/2031	2 350	1 944
Hyundai Capital America 5,800 % éch. 26/06/2025	\$ 2 200	2 197	DTE Electric Co. 1,900 % éch. 01/04/2028	2 200	1 936
TDC Net A/S 5,618 % éch. 06/02/2030	€ 1 900	2 071	Liberty Utilities Finance GP 2,050 % éch. 15/09/2030	2 475	1 911
PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % éch. 26/01/2027	\$ 2 000	2 000	Avangrid, Inc. 3,800 % éch. 01/06/2029	1 965	1 827
DNB Bank ASA 3,625 % éch. 16/02/2027	€ 1 700	1 825	Public Service Co. of Oklahoma 2,200 % éch. 15/08/2031	2 050	1 674
Régie Autonome des Transports Parisiens 3,250 % éch. 11/04/2033	1 400	1 523	Assicurazioni Generali SpA 4,125 % éch. 04/05/2026	€ 1 400	1 535
Bank of America Corp. 4,134 % éch. 12/06/2028	1 400	1 500	Forvia 2,375 % éch. 15/06/2029	1 500	1 296
AIB Group PLC 4,625 % éch. 23/07/2029	1 300	1 403	Verallia S.A. 1,625 % éch. 14/05/2028	1 300	1 193
Schneider Electric SE 3,250 % éch. 12/06/2028	1 200	1 276	Bank of Ireland Group PLC 4,875 % éch. 16/07/2028	1 100	1 185
Bank of Ireland Group PLC 4,875 % éch. 16/07/2028	1 100	1 176	AES Corp. 1,375 % éch. 15/01/2026	\$ 1 300	1 168
Public Service Electric & Gas Co. 4,650 % éch. 15/03/2033	\$ 1 100	1 099	NXP BV 5,000 % éch. 15/01/2033	1 100	1 086
SCE Recovery Funding LLC 5,112 % éch. 14/12/2049	1 000	1 000	Valeo S.A. 1,000 % éch. 03/08/2028	€ 1 200	1 032
Bon du Trésor britannique 3,750 % éch. 22/10/2053	£ 800	995	SCE Recovery Funding LLC 5,112 % éch. 14/12/2049	\$ 1 000	985
Nederlandse Waterschapsbank NV 3,000 % éch. 20/04/2033	€ 900	987	Public Service Co. of Colorado 3,700 % éch. 15/06/2028	1 000	960
Alexandria Real Estate Equities, Inc. 2,000 % éch. 18/05/2032	\$ 1 200	930	Enel Finance International NV 8,875 % éch. 28/09/2034	€ 1 300	959
Société Nationale SNCF S.A. 3,375 % éch. 25/05/2033	€ 800	876	Kilroy Realty LP 2,500 % éch. 15/11/2032	\$ 1 300	953
Export-Import Bank of Korea 5,125 % éch. 11/01/2033	\$ 850	847	Vesteda Finance BV 0,750 % éch. 18/10/2031	€ 1 200	949
Obligation internationale du gouvernement philippin 5,500 % éch. 17/01/2048	800	800	Marks & Spencer PLC 3,750 % éch. 19/05/2026	£ 800	909
Comcast Corp. 4,650 % éch. 15/02/2033	800	799	UBS AG 5,125 % éch. 15/05/2024	\$ 900	893
Ford Motor Credit Co. LLC 6,800 % éch. 12/05/2028	800	799	Export-Import Bank of Korea 5,125 % éch. 11/01/2033	850	890
Danske Bank A/S 4,750 % éch. 21/06/2030	€ 700	758	Citycon Treasury BV 1,625 % éch. 12/03/2028	€ 1 100	881
Commerzbank AG 3,375 % éch. 12/12/2025	700	749	ABN AMRO Bank NV 2,470 % éch. 13/12/2029	\$ 1 000	841
Instituto de Credito Oficial 3,050 % éch. 31/10/2027	700	748	CaixaBank S.A. 0,750 % éch. 26/05/2028	€ 900	839
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 5,520 % éch. 22/02/2055	\$ 700	700	Obligation internationale du gouvernement philippin 5,500 % éch. 17/01/2048	\$ 800	835
AES Corp. 5,450 % éch. 01/06/2028	700	700	Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,125 % éch. 15/06/2028	900	810
SK Hynix, Inc. 6,375 % éch. 17/01/2028	700	697	Comcast Corp. 4,650 % éch. 15/02/2033	800	784
Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong 5,250 % éch. 11/01/2053	700	693	Suez SACA 4,625 % éch. 03/11/2028	€ 700	768
Deutsche Bahn Finance GmbH 3,250 % éch. 19/05/2033	€ 600	648	Instituto de Credito Oficial 3,050 % éch. 31/10/2027	700	744
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,750 % éch. 20/06/2028	600	645	Southern California Edison Co. 2,500 % éch. 01/06/2031	\$ 800	664
UniCredit Bank Austria AG 3,125 % éch. 21/09/2029	600	640	Verizon Communications, Inc. 2,850 % éch. 03/09/2041	900	622
CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % éch. 01/04/2053	\$ 600	600	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % éch. 01/07/2029	700	610
Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % éch. 01/04/2033	600	599	SBB Treasury Oyj 1,125 % éch. 26/11/2029	€ 900	565
Land Securities Capital Markets PLC 4,875 % éch. 15/09/2034	£ 500	586			
MidAmerican Energy Co. 3,650 % éch. 01/08/2048	\$ 750	578			

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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 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)	\$ 108 835	\$ 107 256
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 0,125 % éch. 15/10/2026 (b)	70 611	67 130
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/01/2027 (b)	22 989	22 028	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b)	51 791	50 150
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2025 (b)	13 843	13 229	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/04/2024 (b)	38 784	38 146
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. 15/10/2025 (b)	36 646	35 028
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % éch. 26/05/2025	€ 4 584	4 796	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 1,500 % éch. 15/02/2053 (b)	\$ 2 121	2 109	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b)	22 925	22 077
UBS Group AG 4,177 % éch. 16/01/2026	€ 400	394	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b)	20 504	20 005
ACTIONS			Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b)	19 256	18 236
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	246	2	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2026 (b)	19 151	18 038
			Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2026	£ 12 796	15 454
			Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/07/2028 (b)	\$ 15 727	15 124
			Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (b)	13 946	13 850
			Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 113 300	12 252
			Carbone CLO Ltd. 6,390 % éch. 20/01/2031	\$ 4 576	4 535
			Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053	DKK 42 900	4 471
			Madison Park Funding Ltd. 6,010 % éch. 15/04/2029	\$ 4 483	4 441
			Ares European CLO DAC 3,957 % éch. 15/10/2031	€ 4 000	4 309
			Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 40 200	4 307
			Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,073 % éch. 15/11/2031	€ 3 850	4 043

(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 du produit. 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 Credit Opportunities Bond Fund

30 juin 2023

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
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			
	ACTIONS			ACTIONS	
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	550 196	5 479	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	542 276	5 400
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % éch. 14/08/2024	\$ 1 150	1 102	Billets du Trésor américain 3,125 % éch. 31/08/2027	\$ 3 825	3 727
Mattel, Inc. 3,375 % éch. 01/04/2026	900	828	Netflix, Inc. 5,375 % éch. 15/11/2029	1 300	1 319
Station Casinos LLC 4,625 % éch. 01/12/2031	700	585	Crown Castle, Inc. 2,250 % éch. 15/01/2031	1 200	1 001
Altice France S.A. 5,125 % éch. 15/07/2029	725	525	Buckeye Partners LP 1,000 % éch. 01/11/2026	986	986
Caesars Entertainment, Inc. 7,000 % éch. 15/02/2030	500	500	Citigroup, Inc. 6,270 % éch. 17/11/2033	900	972
Société Générale S.A. 6,691 % éch. 10/01/2034	500	499	USI, Inc. 1,000 % éch. 02/12/2026	970	970
Vornado Realty LP 2,150 % éch. 01/06/2026	600	491	Air Canada 3,875 % éch. 15/08/2026	1 025	923
Weatherford International Ltd. 6,500 % éch. 15/09/2028	400	402	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % éch. 16/11/2025	936	876
Credit Suisse AG 4,713 % éch. 31/05/2024	€ 400	400	Goldman Sachs Group, Inc. 4,482 % éch. 23/08/2028	900	869
Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,450 % éch. 15/09/2028	\$ 500	394	Citigroup, Inc. 3,785 % éch. 17/03/2033	900	804
Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029	€ 400	362	DAE Funding LLC 1,550 % éch. 01/08/2024	800	751
Occidental Petroleum Corp. 7,500 % éch. 01/05/2031	\$ 300	328	Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/08/2032	800	749
Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % éch. 15/02/2029	322	310	LeasePlan Corp. NV 7,375 % éch. 29/05/2024	€ 700	739
EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031	€ 400	309	Sprint LLC 7,875 % éch. 15/09/2023	\$ 600	604
Transocean Titan Financing Ltd. 8,375 % éch. 01/02/2028	\$ 300	306	VeriSign, Inc. 2,700 % éch. 15/06/2031	700	582
Philip Morris International, Inc. 5,375 % éch. 15/02/2033	300	304	White Cap Parent LLC (8,250 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature) 8,250 % éch. 15/03/2026	550	506
Valaris Ltd. 8,375 % éch. 30/04/2030	300	301	Manitowoc Co, Inc. 9,000 % éch. 01/04/2026	500	503
			Service Properties Trust 7,500 % éch. 15/09/2025	500	493

(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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	24 229 226	\$ 241 268	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	29 327 235	\$ 292 033
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 3,450 % éch. 02/02/2061	\$ 34 500	24 317	Setanta Aircraft Leasing DAC 7,538 % éch. 05/11/2028	\$ 48 800	48 721
Occidental Petroleum Corp. 6,625 % éch. 01/09/2030	20 900	22 475		ACTIONS	
Verizon Communications, Inc. 2,355 % éch. 15/03/2032	26 800	21 956	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (a)	3 637 652	40 252
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % éch. 01/06/2031	21 725	21 725		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	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % éch. 17/09/2027	35 400	32 304
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 5,000 % éch. 18/01/2053	20 000	19 153	Renault S.A. 2,375 % éch. 25/05/2026	€ 28 500	27 691
Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,750 % éch. 21/11/2033	15 000	19 142	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % éch. 22/06/2026	\$ 27 523	27 488
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % éch. 01/06/2028	18 775	18 775	HSBC Holdings PLC 4,300 % éch. 08/03/2026	26 700	26 026
Obligation internationale du gouvernement roumain 6,625 % éch. 27/09/2029	€ 14 500	16 268	Deutsche Bank AG 1,625 % éch. 20/01/2027	€ 27 500	25 884
Obligation internationale du gouvernement mexicain 6,350 % éch. 09/02/2035	\$ 15 300	16 034	WP/AP Telecom Holdings BV 7,498 % éch. 30/03/2029	23 100	24 827
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6,150 % éch. 21/05/2048	15 000	15 142	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % éch. 02/10/2026	32 900	24 765
Sprint Capital Corp. 8,750 % éch. 15/03/2032	12 000	14 799	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£ 23 400	23 734
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 5,650 % éch. 27/09/2047	13 700	10 553	UBS AG 5,125 % éch. 15/05/2024	\$ 22 800	22 581
Boeing Co. 5,930 % éch. 01/05/2060	10 000	10 213	Ziggo BV 1,000 % éch. 31/01/2029	€ 19 560	19 917
Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,750 % éch. 12/10/2110	10 000	9 486	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % éch. 31/03/2028	19 200	18 661
Obligation internationale du gouvernement serbe 6,500 % éch. 26/09/2033	9 400	9 450	Casino Guichard-Perrachon S.A. 7,108 % éch. 31/08/2025	22 500	18 351
AT&T, Inc. 3,800 % éch. 01/12/2057	12 200	9 177	ZF Finance GmbH 3,750 % éch. 21/09/2028	18 400	17 424
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % éch. 15/01/2030	8 800	8 800	HSBC Holdings PLC 3,900 % éch. 25/05/2026	\$ 15 900	15 247
Project Mercury 0,000 % éch. 17/07/2030	€ 8 000	8 623	Deutsche Bank AG 1,375 % éch. 17/02/2032	€ 18 100	14 863
Option One Mortgage Loan Trust 5,430 % éch. 25/07/2036	\$ 14 010	8 194	BNP Paribas S.A. 4,705 % éch. 10/01/2025	\$ 14 400	14 256
			Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % éch. 24/06/2024	£ 12 100	14 136
			Deutsche Bank AG 1,750 % éch. 19/11/2030	€ 15 700	13 629
			Lloyds Banking Group PLC 4,450 % éch. 08/05/2025	\$ 13 151	12 840
			Petroleos Mexicanos 6,700 % éch. 16/02/2032	16 100	12 828
			INEOS Finance PLC 6,168 % éch. 08/11/2028	€ 12 100	12 399
			Crédit Agricole S.A. 1,907 % éch. 16/06/2026	\$ 13 350	12 267

(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 du produit. 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

30 juin 2023

ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023	ACTIONS	COÛT (en milliers)	VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	671 735 \$	6 689	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1 241 436 \$	12 362
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,400 % éch. 09/02/2028	\$ 2 800	2 794	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % éch. 22/06/2026	\$ 4 185	4 180
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,750 % éch. 31/12/2032	2 985	2 746	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % éch. 17/09/2027	3 500	3 177
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,875 % éch. 18/07/2033	2 500	2 521	Deutsche Bank AG 1,750 % éch. 19/11/2030	€ 3 600	3 176
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % éch. 01/06/2028	2 200	2 200	ZF Finance GmbH 3,750 % éch. 21/09/2028	3 100	2 934
Obligation internationale du gouvernement roumain 5,000 % éch. 27/09/2026	€ 2 000	2 190	CommScope, Inc. 4,750 % éch. 01/09/2029	\$ 3 600	2 920
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,750 % éch. 18/01/2028	\$ 2 000	1 993	Syngenta Finance NV 3,375 % éch. 16/04/2026	€ 2 600	2 736
Gaci First Investment Co. 4,750 % éch. 14/02/2030	2 000	1 979	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % éch. 28/04/2025	2 700	2 709
Occidental Petroleum Corp. 7,875 % éch. 15/09/2031	1 700	1 936	CGG S.A. 8,750 % éch. 01/04/2027	\$ 2 800	2 417
Verizon Communications, Inc. 2,355 % éch. 15/03/2032	2 200	1 802	Altice Financing S.A. 5,750 % éch. 15/08/2029	3 000	2 370
Sprint Capital Corp. 6,875 % éch. 15/11/2028	1 385	1 495	Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % éch. 30/09/2023	2 400	2 320
Netflix, Inc. 4,875 % éch. 15/06/2030	1 400	1 391	UniCredit SpA 7,830 % éch. 04/12/2023	2 200	2 240
Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,750 % éch. 21/11/2033	1 000	1 276	Casino Guichard-Perrachon S.A. 7,108 % éch. 31/08/2025	€ 2 600	2 190
Obligation internationale du gouvernement mexicain 3,771 % éch. 24/05/2061	1 600	1 107	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,750 % éch. 18/01/2028	\$ 2 000	2 020
Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % éch. 23/02/2038	1 100	1 100	Deutsche Bank AG 3,547 % éch. 18/09/2031	2 100	1 777
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,520 % éch. 25/02/2037	2 512	1 091	Renault S.A. 2,375 % éch. 25/05/2026	€ 1 800	1 735
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,500 % éch. 26/10/2046	1 200	1 084	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£ 1 700	1 721
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6,150 % éch. 21/05/2048	1 000	1 011	Freedom Mortgage Corp. 7,625 % éch. 01/05/2026	\$ 2 100	1 676
Obligation internationale du gouvernement serbe 6,500 % éch. 26/09/2033	1 000	1 006	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % éch. 02/10/2026	€ 2 000	1 542
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % éch. 15/01/2030	1 000	1 000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 4,500 % éch. 01/03/2025	1 400	1 470
HCA, Inc. 5,500 % éch. 01/06/2033	1 000	999	Deutsche Bank AG 5,882 % éch. 08/07/2031	\$ 1 700	1 468
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 3,450 % éch. 02/02/2061	1 400	963	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % éch. 31/03/2028	€ 1 500	1 441
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 5,650 % éch. 27/09/2047	1 200	924	Tierra Mojada Luxembourg SARL 5,750 % éch. 01/12/2040	\$ 1 663	1 432
WMG Acquisition Corp. 3,000 % éch. 15/02/2031	1 100	920	Plains All American Pipeline LP 4,900 % éch. 15/02/2045	1 700	1 366
Obligation internationale du gouvernement philippin 5,000 % éch. 17/07/2033	800	800	Level 3 Financing, Inc. 6,967 % éch. 01/03/2027	1 600	1 320
Charter Communications Operating LLC 3,850 % éch. 01/04/2061	1 200	759	Nakilat, Inc. 6,067 % éch. 31/12/2033	1 159	1 214
Occidental Petroleum Corp. 6,625 % éch. 01/09/2030	700	754	IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature) 3,750 % éch. 15/09/2026	€ 1 200	1 127
Gaci First Investment Co. 5,125 % éch. 14/02/2053	800	730	Marks & Spencer PLC 4,500 % éch. 10/07/2027	£ 1 000	1 119
Crown Castle, Inc. 5,000 % éch. 11/01/2028	700	705	Jaguar Land Rover Automotive PLC 5,875 % éch. 15/11/2024	€ 1 000	1 012
PRA Group, Inc. 8,375 % éch. 01/02/2028	700	700	Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % éch. 24/06/2024	£ 800	934
Sirius XM Radio, Inc. 4,125 % éch. 01/07/2030	800	697	Wynn Resorts Finance LLC 5,125 % éch. 01/10/2029	\$ 1 000	915
DISH Network Corp. 11,750 % éch. 15/11/2027	675	689	WP/AP Telecom Holdings BV 7,498 % éch. 30/03/2029	€ 800	864
Crown Castle, Inc. 2,250 % éch. 15/01/2031	800	667	Petroleos Mexicanos 7,690 % éch. 23/01/2050	\$ 1 200	853
Nokia Oyj 6,625 % éch. 15/05/2039	600	621			

(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 dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (a)	426 683	\$ 4 337	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (a)	81 957	\$ 833
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (a)	147 887	1 485		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		BNP Paribas S.A. 1,675 % éch. 30/06/2027	\$ 400	355
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/04/2053	\$ 1 000	993	Obligation internationale du gouvernement uruguayen 5,100 % éch. 18/06/2050	300	306
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/05/2053	912	919	KBC Group NV 5,796 % éch. 19/01/2029	300	301
Obligation internationale du gouvernement uruguayen 5,100 % éch. 18/06/2050	700	720	Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 4,500 % éch. 30/01/2030	300	265
Obligation internationale du gouvernement panaméen 6,700 % éch. 26/01/2036	600	648	Obligation internationale du gouvernement péruvien 3,000 % éch. 15/01/2034	300	250
Bank of America Corp. 6,204 % éch. 10/11/2028	600	627	Obligation internationale du gouvernement brésilien 4,750 % éch. 14/01/2050	300	219
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 4,500 % éch. 30/01/2030	600	530	Obligation internationale du gouvernement panaméen 4,500 % éch. 19/01/2063	300	219
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % éch. 06/06/2032	500	509	Obligation internationale du gouvernement omanais 6,000 % éch. 01/08/2029	200	206
JPMorgan Chase & Co. 2,580 % éch. 22/04/2032	600	504	Obligation internationale du gouvernement omanais 6,750 % éch. 17/01/2048	200	199
Sprint Capital Corp. 8,750 % éch. 15/03/2032	400	492	Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,750 % éch. 12/10/2110	225	198
Obligation internationale du gouvernement colombien 7,500 % éch. 02/02/2034	500	487	Obligation internationale du gouvernement colombien 7,500 % éch. 02/02/2034	200	190
Obligation internationale du gouvernement mexicain 4,875 % éch. 19/05/2033	500	485	Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 6,125 % éch. 15/06/2033	200	180
Obligation internationale du gouvernement péruvien 3,000 % éch. 15/01/2034	500	418	Natura Cosmetics S.A. 4,125 % éch. 03/05/2028	200	162
Amgen, Inc. 3,000 % éch. 22/02/2029	450	417	Obligation internationale du gouvernement chilien 3,100 % éch. 07/05/2041	200	153
WMG Acquisition Corp. 2,250 % éch. 15/08/2031	€ 400	345	Obligation internationale du gouvernement marocain 4,000 % éch. 15/12/2050	200	138
Southern California Edison Co. 2,500 % éch. 01/06/2031	\$ 400	343	MPT Operating Partnership LP 3,500 % éch. 15/03/2031	200	137
SBA Communications Corp. 3,125 % éch. 01/02/2029	400	342	ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027	125	119
Air Canada Pass-Through Trust 5,250 % éch. 01/10/2030	343	335	Obligation internationale du gouvernement argentin 1,500 % éch. 09/07/2035	500	112
IQVIA, Inc. 2,250 % éch. 15/01/2028	€ 350	334	TDC Net A/S 5,056 % éch. 31/05/2028	€ 100	108
			Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£ 100	101
			ING Groep NV 1,125 % éch. 07/12/2028	100	99
			Verallia S.A. 1,625 % éch. 14/05/2028	€ 100	97
			IQVIA, Inc. 2,250 % éch. 15/01/2028	100	95
			Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % éch. 03/12/2027	100	94
			Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % éch. 15/02/2025	\$ 100	93
			HSBC Holdings PLC 3,973 % éch. 22/05/2030	100	92
			G City Europe Ltd. 4,250 % éch. 11/09/2025	€ 100	92
			Altice Financing S.A. 4,250 % éch. 15/08/2029	100	91
			Banco BTG Pactual S.A. 2,750 % éch. 11/01/2026	\$ 100	91
			Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 6,500 % éch. 15/02/2048	100	89
			Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % éch. 14/01/2029	100	87
			Dana, Inc. 4,250 % éch. 01/09/2030	100	84
			Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 6,625 % éch. 22/03/2048	€ 100	80
			Obligation internationale du gouvernement colombien 5,000 % éch. 15/06/2045	\$ 100	71
			Microsoft Corp. 2,675 % éch. 01/06/2060	100	70

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	6 757 953	\$ 67 295	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8 234 342	\$ 82 000
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 20/04/2023	HUF 12 975 000	37 913	Caesars Entertainment Corp. 8,452 % éch. 06/02/2030	\$ 5 500	5 486
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 13/04/2023	12 927 000	37 254	Zayo Group Holdings, Inc. 8,217 % éch. 09/03/2027	6 204	5 028
Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026	€ 23 400	24 989	Bank of America Corp. 4,125 % éch. 22/01/2024	5 050	4 993
Stratton Mortgage Funding PLC 5,991 % éch. 20/07/2060	£ 10 705	11 546		ACTIONS	
Caesars Entertainment Corp. 8,452 % éch. 06/02/2030	\$ 7 000	6 930	Nationwide Building Society	31 186	4 794
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % éch. 02/03/2026	€ 6 500	6 888		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
DISH Network Corp. 11,750 % éch. 15/11/2027	\$ 6 400	6 528	U.S. Foods, Inc. 7,943 % éch. 22/11/2028	\$ 4 021	4 016
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % éch. 15/01/2030	4 800	4 800	Volkswagen Financial Services NV 1,125 % éch. 18/09/2023	£ 3 300	3 829
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. 3,375 % éch. 24/07/2024	5 000	4 625	Obligation internationale du gouvernement israélien 2,750 % éch. 03/07/2030	\$ 4 000	3 640
Resloc UK PLC 3,776 % éch. 15/12/2043	€ 4 756	4 139	Obligation internationale du gouvernement israélien 3,800 % éch. 13/05/2060	4 600	3 611
HSBC Holdings PLC 6,254 % éch. 09/03/2034	\$ 3 800	3 800	Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,940 % éch. 12/02/2029	PEN 12 900	3 105
Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % éch. 15/01/2033	3 800	3 790	Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % éch. 22/09/2026	€ 2 800	2 720
Obligation internationale du gouvernement mexicain 6,350 % éch. 09/02/2035	3 700	3 686	Organon & Co. 8,250 % éch. 02/06/2028	\$ 2 543	2 536
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % éch. 06/04/2026	€ 3 300	3 574	Morgan Stanley 3,875 % éch. 29/04/2024	2 575	2 530
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. 3,100 % éch. 02/02/2031	\$ 5 000	3 400	Imperial Brands Finance PLC 2,125 % éch. 12/02/2027	€ 2 500	2 529
Adler Financing SARL 12,500 % éch. 30/06/2025	€ 2 989	3 057	HSBC Holdings PLC 3,356 % éch. 18/05/2024	\$ 2 300	2 303
Trinity Square PLC 5,316 % éch. 15/07/2059	£ 2 153	2 608	MPT Operating Partnership LP 2,500 % éch. 24/03/2026	£ 2 500	2 227
Canada Square Funding PLC 5,316 % éch. 17/01/2059	2 380	2 574	Zayo Group Holdings, Inc. 1,000 % éch. 09/03/2027	€ 1 940	1 775
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,841 % éch. 20/07/2045	2 049	2 481	Hilton Grand Vacations Borrower LLC 8,239 % éch. 02/08/2028	\$ 1 576	1 570
			Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % éch. 15/03/2024	1 500	1 461
			Adient U.S. LLC 8,334 % éch. 10/04/2028	1 016	1 016

(a) Le Fonds Dynamic 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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)	\$ 596 057	€ 521 863	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)	\$ 129 728	€ 112 978
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)	187 147	176 014	ACTIONS		
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b)	179 512	164 394	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	930 100	90 255
Obligation internationale du gouvernement français 4,250 % éch. 25/10/2023	€ 117 260	117 530	Vertex Pharmaceuticals, Inc.	192 000	60 007
Bons du Trésor français 0,000 % éch. 16/03/2022	47 000	47 008	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/05/2023	45 430	45 337	Obligation internationale du gouvernement italien 0,000 % éch. 31/03/2023	€ 56 400	56 206
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 11/09/2023	¥ 5 000 000	33 366	ACTIONS		
Bons du Trésor français 0,000 % éch. 29/03/2023	€ 32 400	32 248	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	60 700	42 844
Tower Bridge Funding PLC 5,991 % éch. 20/10/2064	£ 26 200	29 919	Humana, Inc.	92 270	41 597
Obligation internationale du gouvernement italien 0,000 % éch. 31/03/2023	€ 29 400	29 242	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	2 411 000	40 099
CVS Health Corp. 5,000 % éch. 20/02/2026	\$ 29 300	27 240	Lam Research Corp.	71 670	37 689
London Wall Mortgage Capital PLC 5,452 % éch. 15/05/2051	£ 24 207	27 022	Elevance Health, Inc.	85 930	36 114
Obligation internationale du gouvernement roumain 5,000 % éch. 27/09/2026	€ 26 000	26 188	Exxon Mobil Corp.	365 700	35 538
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % éch. 01/05/2023	20 000	20 093	Applied Materials, Inc.	291 300	34 744
Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/03/2023	19 700	19 652	NetApp, Inc.	529 300	33 923
ACTIONS			VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Siemens Energy AG	883 100	16 236	Bons du Trésor français 0,000 % éch. 29/03/2023	€ 32 400	32 260
VALEUR NOMINALE (en milliers)			ACTIONS		
SK Hynix, Inc. 6,250 % éch. 17/01/2026	\$ 16 200	15 043	Samsung Electronics Co. Ltd.	625 600	30 606
Exportation et Développement Canada 4,000 % éch. 19/02/2026	£ 12 500	14 080	Micron Technology, Inc.	431 200	27 811
State Street Corp. 4,857 % éch. 26/01/2026	\$ 15 200	13 990	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	222 460	26 507
Union Pacific Corp. 4,750 % éch. 21/02/2026	14 600	13 611	Incyte Corp.	456 300	25 883
			Tokyo Electron Ltd.	82 670	25 733
			Hologic, Inc.	331 200	24 970
			Teradyne, Inc.	256 700	24 869
			Ambarella, Inc.	308 000	23 187
			Marvell Technology, Inc.	388 800	22 531
			Ibiden Co Ltd.	426 700	21 433
			BYD Co. Ltd. « H »	766 000	21 431
			Advantest Corp.	323 200	20 131
			VALEUR NOMINALE (en milliers)		
			Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % éch. 01/05/2023	€ 20 000	20 070
			ACTIONS		
			Exelixis, Inc.	1 135 300	19 959
			Aptiv PLC	214 100	19 845
			United Therapeutics Corp.	94 600	19 699
			United Microelectronics Corp.	12 406 000	19 037
			Mitsubishi Electric Corp.	2 025 370	18 648
			Nitto Denko Corp.	332 800	18 471

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	105 350 625	\$ 1 049 012	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	91 645 449	\$ 912 600
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,350 % éch. 17/06/2026	THB 3 247 762	95 107	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,350 % éch. 17/06/2033	THB 2 212 958	68 827
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,350 % éch. 17/06/2033	2 281 608	71 967	Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,000 % éch. 06/03/2025	MXN 1 173 200	61 851
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,650 % éch. 17/06/2028	2 263 201	67 815	Émission d'investissement du gouvernement malaisien 3,990 % éch. 15/10/2025	MYR 267 690	61 298
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 6,000 % éch. 01/04/2033	CLP 46 955 000	60 421	Obligation internationale du gouvernement indonésien 7,000 % éch. 15/02/2033	IDR 681 081 000	47 647
Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,000 % éch. 06/03/2025	MXN 1 173 200	56 775	Obligation internationale du gouvernement roumain 4,500 % éch. 17/06/2024	RON 212 500	45 884
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 962 000	55 705	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,390 % éch. 17/06/2037	THB 1 344 200	42 526
Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2033	PEN 194 300	52 760	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,350 % éch. 17/06/2026	1 376 638	40 250
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028	MYR 217 968	51 095	Obligation internationale du gouvernement chinois 3,030 % éch. 11/03/2026	CNY 245 690	35 148
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 20/04/2023	HUF 16 383 000	47 871	TES colombien 9,250 % éch. 28/05/2042	COP 179 039 600	31 788
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 13/04/2023	16 323 000	47 041	TES colombien 13,250 % éch. 09/02/2033	113 676 500	27 479
Obligation internationale du gouvernement chinois 2,620 % éch. 25/09/2029	CNY 308 300	42 982	TES colombien 3,750 % éch. 25/02/2037	122 979 368	22 721
Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,200 % éch. 12/08/2026	PEN 150 200	41 761	Obligation internationale du gouvernement sud-africain 6,500 % éch. 28/02/2041	ZAR 607 449	20 659
TES colombien 13,250 % éch. 09/02/2033	COP 187 473 900	40 527	Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % éch. 31/01/2030	399 900	20 627
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,800 % éch. 17/08/2023	MYR 176 400	37 834	TES colombien 2,250 % éch. 18/04/2029	COP 98 665 684	20 079
Obligation internationale du gouvernement indonésien 7,500 % éch. 15/06/2035	IDR 483 620 000	34 175	Obligation internationale du gouvernement indonésien 7,500 % éch. 15/06/2035	IDR 246 840 000	18 024
Obligation internationale du gouvernement hongrois 6,750 % éch. 22/10/2028	HUF 11 684 600	29 879	Obligation internationale du gouvernement indonésien 7,125 % éch. 15/06/2038	237 219 000	15 899
Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,500 % éch. 04/03/2027	MXN 616 000	29 103	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,000 % éch. 17/12/2031	THB 508 070	14 000
Obligation internationale du gouvernement chinois 2,600 % éch. 01/09/2032	CNY 201 010	27 869	Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,757 % éch. 22/05/2040	MYR 64 468	13 646
Billets de la Banque centrale de République dominicaine 13,000 % éch. 05/12/2025	DOP 1 634 500	27 039	Obligation du gouvernement chinois 2,700 % éch. 03/11/2026	CNY 96 600	13 620

(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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,350 % éch. 17/06/2026	THB 10 109	\$ 296	Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 2 900	\$ 178
Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2033	PEN 950	262	Obligation internationale du gouvernement roumain 3,250 % éch. 29/04/2024	RON 800	171
Obligation internationale du gouvernement polonais 7,500 % éch. 25/07/2028	PLN 800	198	Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 08/02/2023	ILS 500	148
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,650 % éch. 17/06/2028	THB 5 419	163	Obligation internationale du gouvernement israélien 0,150 % éch. 31/07/2023	500	136
Société financière internationale 8,000 % éch. 09/10/2023	IDR 2 200 000	148	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,390 % éch. 17/06/2037	THB 3 900	125
Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,200 % éch. 12/08/2026	PEN 500	138	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 2 800	131	Obligation internationale du gouvernement sud-africain 6,500 % éch. 28/02/2041	ZAR 3 300	112
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % éch. 01/04/2033	CLP 100 000	129	Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023	¥ 14 000	108
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 5,800 % éch. 19/01/2028	ZAR 2 500	125	Banque européenne d'investissement 3,000 % éch. 25/11/2029	PLN 500	99
Obligation internationale du gouvernement polonais 6,000 % éch. 25/10/2033	PLN 500	115	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,350 % éch. 17/06/2033	THB 2 510	80
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023	¥ 14 000	110	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,350 % éch. 17/06/2026	2 690	79
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,800 % éch. 17/08/2023	MYR 500	107	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 1,585 % éch. 17/12/2035	2 920	73
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque 5,000 % éch. 30/09/2030	CZK 2 200	105	Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,582 % éch. 15/07/2032	MYR 320	70
Banque Internationale pour la Reconstruction et le Développement 8,500 % éch. 06/04/2026	MXN 2 000	100	TES colombien 3,750 % éch. 25/02/2037	COP 366 443	69
Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/04/2032	IDR 1 467 000	99	Obligation internationale du gouvernement indonésien 7,000 % éch. 15/02/2033	IDR 974 000	67
Banque européenne d'investissement 2,875 % éch. 15/11/2029	PLN 500	98	TES colombien 9,250 % éch. 28/05/2042	COP 313 000	55
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 1 700	93	Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,900 % éch. 12/08/2037	PEN 200	50
Banque européenne d'investissement 3,000 % éch. 25/11/2029	PLN 500	91	Billets de la Banque centrale de République dominicaine 13,000 % éch. 30/01/2026	DOP 2 500	47
Billets de la Banque centrale de République dominicaine 13,000 % éch. 05/12/2025	DOP 5 300	88	Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028	MYR 198	47
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,350 % éch. 17/06/2033	THB 2 642	84	Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 700	42
Banque Internationale pour la Reconstruction et le Développement 7,070 % éch. 26/06/2029	MXN 1 400	70	Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/04/2042	IDR 610 000	40
Banque de développement asiatique 12,750 % éch. 03/03/2025	COP 339 000	68	Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,757 % éch. 22/05/2040	MYR 188	40
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,400 % éch. 17/06/2036	THB 2 001	65	TES colombien 2,250 % éch. 18/04/2029	COP 169 408	34
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,193 % éch. 07/10/2032	MYR 278	64	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,650 % éch. 17/06/2028	THB 1 070	32
TES colombien 3,750 % éch. 25/02/2037	COP 363 205	63	Billets de la Banque centrale de République dominicaine 13,000 % éch. 05/12/2025	DOP 1 700	32
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 9,000 % éch. 31/01/2040	ZAR 1 400	61	Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,000 % éch. 22/02/2027	€ 30	32
Obligation internationale du gouvernement hongrois 6,750 % éch. 22/10/2028	HUF 22 800	60	Obligation internationale du gouvernement malaisien 4,696 % éch. 15/10/2042	MYR 134	32
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,750 % éch. 31/01/2044	ZAR 1 400	59	Obligation internationale du gouvernement indonésien 7,500 % éch. 15/06/2035	IDR 388 000	28
TES colombien 9,250 % éch. 28/05/2042	COP 313 000	51	Émission d'investissement du gouvernement malaisien 3,990 % éch. 15/10/2025	MYR 120	27
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 3,465 % éch. 15/10/2030	MYR 230	51	Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS 100	27
Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,400 % éch. 12/08/2034	PEN 200	48			
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,000 % éch. 17/12/2031	THB 1 520	45			
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 13,625 % éch. 10/02/2034	DOP 2 000	44			
Obligation internationale du gouvernement malaisien 2,632 % éch. 15/04/2031	MYR 210	44			

Les variations importantes de la composition 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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	85 561 931	\$ 852 006	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	87 959 244	\$ 875 900
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 28/02/2030	\$ 33 100	32 946	CBB International Sukuk Programme Co. 6,250 % éch. 18/10/2030	\$ 21 000	21 171
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 484 900	28 930	Obligation internationale du gouvernement égyptien 4,750 % éch. 16/04/2026	€ 14 508	13 585
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,875 % éch. 18/07/2033	\$ 28 400	28 065	Obligation internationale du gouvernement chilien 2,750 % éch. 31/01/2027	\$ 13 400	12 720
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,750 % éch. 18/01/2028		27 504	Standard Chartered PLC 7,767 % éch. 16/11/2028	11 200	11 943
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,800 % éch. 17/08/2023	MYR 107 200	22 992	Obligation internationale du gouvernement colombien 4,000 % éch. 26/02/2024	12 100	11 933
CBB International Sukuk Programme Co. 6,250 % éch. 18/10/2030	\$ 21 000	21 000	Obligation internationale du gouvernement nigérian 6,500 % éch. 28/11/2027	13 000	11 306
Obligation internationale du gouvernement mexicain 6,350 % éch. 09/02/2035	16 400	16 340	Nogaholding Sukuk Ltd. 6,625 % éch. 25/05/2033	10 200	10 216
Obligation internationale du gouvernement nigérian 6,500 % éch. 28/11/2027	18 844	15 749	Obligation internationale du gouvernement serbe 6,250 % éch. 26/05/2028	9 950	9 883
Banque de développement hongrois 6,500 % éch. 29/06/2028	15 300	15 131	Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,850 % éch. 11/01/2033	9 700	9 754
Ecopetrol S.A. 0,000 % éch. 17/08/2024	15 200	14 668	Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,000 % éch. 22/02/2027	€ 8 200	8 829
Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,550 % éch. 14/03/2037	13 300	14 614	CK Hutchison International Ltd. 4,750 % éch. 21/04/2028	\$ 8 800	8 828
Gaci First Investment Co. 5,125 % éch. 14/02/2053	15 600	14 553	Obligation internationale du gouvernement mexicain 4,280 % éch. 14/08/2041	10 491	8 685
Nogaholding Sukuk Ltd. 6,625 % éch. 25/05/2033	13 900	13 900	Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,750 % éch. 31/12/2032	9 347	8 589
Billets de la Banque centrale de République dominicaine 13,000 % éch. 05/12/2025	DOP 833 500	13 779	CK Hutchison International Ltd. 4,875 % éch. 21/04/2033	8 400	8 432
Obligation internationale du gouvernement polonais 4,875 % éch. 04/10/2033	\$ 13 400	13 327	Obligation internationale du gouvernement marocain 6,500 % éch. 08/09/2033	7 600	7 916
Obligation internationale du gouvernement turc 9,125 % éch. 13/07/2030	12 000	11 894	Gaci First Investment Co. 5,375 % éch. 13/10/2122	8 000	7 731
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS 41 700	11 583	Obligation internationale du gouvernement sud-africain 4,850 % éch. 30/09/2029	8 500	7 719
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 13,625 % éch. 03/02/2033	DOP 631 800	11 158	Obligation internationale du gouvernement hongrois 6,750 % éch. 25/09/2052	7 300	7 486
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 13,625 % éch. 10/02/2034	489 000	10 813	Petroleos Mexicanos 6,950 % éch. 28/01/2060	9 800	6 630

(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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)	DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023					VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023				
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	324 500	\$	19 365	Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS	152 300	\$	40 645
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS	62 400		17 333	Obligation internationale du gouvernement israélien 0,150 % éch. 31/07/2023		79 600		21 341
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,800 % éch. 17/08/2023	MYR	74 400		15 957	Obligation internationale du gouvernement mexicain 6,350 % éch. 09/02/2035	\$	14 000		14 659
Obligation internationale du gouvernement hongrois 6,750 % éch. 25/09/2052	\$	16 600		15 891	Obligation internationale du gouvernement sud- africain 4,300 % éch. 12/10/2028		14 500		13 268
Obligation internationale du gouvernement mexicain 4,875 % éch. 19/05/2033		15 800		15 097	Obligation internationale du gouvernement israélien 4,500 % éch. 17/01/2033		13 400		13 224
Obligation internationale du gouvernement polonais 4,875 % éch. 04/10/2033		14 700		14 609	Obligation internationale du gouvernement sud- africain 5,875 % éch. 20/04/2032		13 500		12 538
Obligation internationale du gouvernement mexicain 6,350 % éch. 09/02/2035		14 000		13 948	Obligation internationale du gouvernement chilien 2,750 % éch. 31/01/2027		12 900		12 245
Obligation internationale du gouvernement israélien 4,500 % éch. 17/01/2033		13 400		13 322	OTP Bank Nyrt 8,750 % éch. 15/05/2033		12 300		12 194
Obligation internationale du gouvernement colombien 7,500 % éch. 02/02/2034		12 510		12 418	Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,000 % éch. 22/02/2027	€	10 600		11 416
OTP Bank Nyrt 8,750 % éch. 15/05/2033		12 300		12 228	Obligation internationale du gouvernement serbe 6,250 % éch. 26/05/2028	\$	10 950		10 915
Département des finances du gouvernement de Sharjah 6,500 % éch. 23/11/2032		12 300		12 199	Sociedad Química y Minera de Chile S.A. 3,500 % éch. 10/09/2051		13 700		9 575
Obligation internationale du gouvernement uruguayen 5,750 % éch. 28/10/2034		11 200		12 168	Obligation internationale du gouvernement colombien 6,125 % éch. 18/01/2041		11 400		8 922
Obligation internationale du gouvernement polonais 5,500 % éch. 04/04/2053		11 500		11 359	Obligation internationale du gouvernement polonais 2,750 % éch. 25/05/2032	€	9 100		8 888
Billets de la Banque centrale de République dominicaine 13,000 % éch. 05/12/2025	DOP	685 100		11 321	Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,400 % éch. 09/02/2028	\$	8 700		8 829
Obligation internationale du gouvernement roumain 7,625 % éch. 17/01/2053	\$	11 100		11 040	Obligation internationale du gouvernement israélien 4,250 % éch. 31/03/2023	ILS	30 500		8 658
Obligation internationale du gouvernement bulgare 4,500 % éch. 27/01/2033	€	10 400		10 988	Obligation internationale du gouvernement uruguayen 7,875 % éch. 15/01/2033	\$	6 930		8 532
Obligation internationale du gouvernement serbe 6,250 % éch. 26/05/2028	\$	10 950		10 909	Obligation internationale du gouvernement égyptien 5,250 % éch. 06/10/2025		10 600		8 431
Banque de développement hongroise 6,500 % éch. 29/06/2028		10 900		10 780	Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,750 % éch. 31/12/2032		8 942		8 222
Obligation internationale du gouvernement philippin 5,500 % éch. 17/01/2048		10 600		10 588	Standard Chartered PLC 7,767 % éch. 16/11/2028		7 600		8 104
Obligation internationale du gouvernement serbe 6,500 % éch. 26/09/2033		10 500		10 274	Banque de développement et de commerce d'Afrique orientale et australe 4,125 % éch. 30/06/2028		9 900		7 884
IHS Netherlands Holdco BV 8,000 % éch. 18/09/2027		10 700		9 658	Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,850 % éch. 11/01/2033		7 400		7 439
Obligation internationale du gouvernement polonais 2,750 % éch. 25/05/2032	€	9 100		8 906	Banco do Brasil S.A. 3,250 % éch. 30/09/2026		8 100		7 341
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 13,625 % éch. 03/02/2033	DOP	500 900		8 847	Obligation internationale du gouvernement mongol 3,500 % éch. 07/07/2027		8 600		7 046
Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,400 % éch. 09/02/2028	\$	8 700		8 683	Obligation internationale du gouvernement qatari 3,250 % éch. 02/06/2026		7 000		6 759
Export-Import Bank of Korea 5,125 % éch. 11/01/2033		8 400		8 366	Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % éch. 03/05/2028		8 100		6 510
Obligation internationale du gouvernement roumain 2,000 % éch. 14/04/2033	€	11 300		8 340	Obligation internationale du gouvernement philippin 3,200 % éch. 06/07/2046		8 700		6 430
Obligation internationale du gouvernement jordanien 7,500 % éch. 13/01/2029	\$	8 000		7 904	XP, Inc. 3,250 % éch. 01/07/2026		7 400		6 377
Magyar Export-Import Bank 6,125 % éch. 04/12/2027		7 500		7 443	Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong 4,625 % éch. 11/01/2033		6 200		6 319
Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,850 % éch. 11/01/2033		7 400		7 257	Greenko Dutch BV 3,850 % éch. 29/03/2026		6 956		6 266
Airport Authority Hong Kong 4,875 % éch. 12/01/2030		7 200		7 155	Obligation internationale du gouvernement marocain 6,500 % éch. 08/09/2033		5 900		5 922
Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du nord 6,960 % éch. 13/03/2027	€	6 700		7 085	Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong 4,500 % éch. 11/01/2028		5 800		5 834
Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375 % éch. 22/05/2033	\$	7 000		6 983	Obligation internationale du gouvernement mexicain 3,771 % éch. 24/05/2061		8 200		5 520
First Abu Dhabi Bank PJSC 4,774 % éch. 06/06/2028		6 500		6 500	Obligation internationale du gouvernement polonais 5,500 % éch. 16/11/2027		5 100		5 278
Polaris PLC 6,141 % éch. 23/05/2059	£	5 300		6 480					
Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du nord 5,625 % éch. 26/07/2023	€	5 800		6 197					
Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong 4,625 % éch. 11/01/2033	\$	6 200		6 177					
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 13,625 % éch. 10/02/2034	DOP	277 400		6 130					
Obligation internationale du gouvernement costaricain 6,550 % éch. 03/04/2034	\$	6 000		6 000					
Obligation internationale du gouvernement marocain 6,500 % éch. 08/09/2033		5 900		5 855					
Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong 3,750 % éch. 07/06/2032	€	5 500		5 821					
Khazanah Global Sukuk Bhd. 4,687 % éch. 01/06/2028	\$	5 800		5 800					
Corp. Nacional del Cobre de Chile 5,125 % éch. 02/02/2033		5 800		5 796					
Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong 4,500 % éch. 11/01/2028		5 800		5 778					

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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3 481 150	\$ 34 663	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3 561 054	\$ 35 460
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023	¥ 430 000	3 373	Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS 6 000	1 650
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % éch. 18/07/2033	\$ 2 200	2 200	Bank Leumi Le-Israel B.M. 3,275 % éch. 29/01/2031	\$ 1 800	1 631
Obligation internationale du gouvernement colombien 7,500 % éch. 02/02/2034	1 500	1 489	QNB Finance Ltd. 3,500 % éch. 28/03/2024	1 548	1 524
KazMunayGas National Co. JSC 6,375 % éch. 24/10/2048	1 500	1 277	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	1 300	1 153	Mizrahi Tefahot Bank Ltd. 3,077 % éch. 07/04/2031	1 300	1 167
Seazen Group Ltd. 4,450 % éch. 13/07/2025	1 400	1 132	New Metro Global Ltd. 6,800 % éch. 05/08/2023	1 100	1 055
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC 4,375 % éch. 24/01/2029	1 100	1 093	Rio Oil Finance Trust 8,200 % éch. 06/04/2028	968	973
Ecopetrol S.A. 0,000 % éch. 17/08/2024	1 000	965	ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % éch. 24/01/2028	1 000	962
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd. 3,750 % éch. 27/07/2026	1 000	954	Bank Hapoalim B.M. 3,255 % éch. 21/01/2032	1 100	923
NBK SPC Ltd. 1,625 % éch. 15/09/2027	800	714	Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % éch. 18/07/2033	900	872
SK on Co. Ltd. 5,375 % éch. 11/05/2026	700	699	S.A. Global Sukuk Ltd. 2,694 % éch. 17/06/2031	1 000	871
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 3,500 % éch. 31/03/2027	700	665	Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % éch. 22/02/2032	1 000	871
Melco Resorts Finance Ltd. 5,625 % éch. 17/07/2027	700	641	Obligation internationale du gouvernement israélien 0,150 % éch. 31/07/2023	ILS 2 700	752
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 5,950 % éch. 17/07/2026	600	599	Xiaomi Best Time International Ltd. 2,875 % éch. 14/07/2031	\$ 900	684
POSCO 5,750 % éch. 17/01/2028	600	597	Bangkok Bank PCL 3,733 % éch. 25/09/2034	800	678
Standard Chartered PLC 7,767 % éch. 16/11/2028	500	547	POSCO 5,750 % éch. 17/01/2028	600	618
Kasikornbank PCL 3,343 % éch. 02/10/2031	600	532	Leviathan Bond Ltd. 6,125 % éch. 30/06/2025	600	578
Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % éch. 23/02/2038	500	500	Banco de Credito e Inversiones S.A. 3,500 % éch. 12/10/2027	600	550
Sasol Financing USA LLC 8,750 % éch. 03/05/2029	500	500	Studio City Finance Ltd. 6,500 % éch. 15/01/2028	600	510

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 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	Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 03/05/2023	ILS 1 600	438
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 27/04/2023	HUF 306 000	882	Export-Import Bank of Korea 4,890 % éch. 09/08/2023	INR 26 600	322
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 20/04/2023	164 000	479	Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2023	PEN 900	251
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 13/04/2023	163 000	470	Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 3 600	229
Obligation internationale du gouvernement péruvien 7,300 % éch. 12/08/2023	PEN 1 300	353	Standard Chartered PLC 6,170 % éch. 09/01/2027	\$ 200	204
Export-Import Bank of Korea 4,890 % éch. 09/08/2023	INR 26 600	322	Danske Bank A/S 6,466 % éch. 09/01/2026	200	203
Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,000 % éch. 03/09/2026	MXN 4 900	267	TES colombien 9,250 % éch. 28/05/2042	COP 1 167 800	203
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % éch. 18/07/2023	\$ 200	200	Gacil First Investment Co. 4,750 % éch. 14/02/2030	\$ 200	202
Danske Bank A/S 6,466 % éch. 09/01/2026	200	200	Lloyds Banking Group PLC 4,716 % éch. 11/08/2026	200	196
Standard Chartered PLC 6,170 % éch. 09/01/2027	200	200	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % éch. 29/07/2026	200	185
Gacil First Investment Co. 4,750 % éch. 14/02/2030	200	198	TES colombien 13,250 % éch. 09/02/2033	COP 663 500	168
Banque de développement hongrois 6,500 % éch. 29/06/2028	200	198	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053	DKK 1 467	166
TES colombien 13,250 % éch. 09/02/2033	COP 663 500	144	ACTIONS		
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 13,625 % éch. 03/02/2033	DOP 8 000	141	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	10 041	100
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 2 000	116	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	1 000	99
ACTIONS			VALEUR NOMINALE (en milliers)		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	10 112	101	Leviathan Bond Ltd. 6,125 % éch. 30/06/2025	\$ 100	99
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		TES colombien 2,250 % éch. 18/04/2029	COP 479 715	99
Petroleos Mexicanos 10,000 % éch. 07/02/2033	\$ 100	98	Nakilat, Inc. 6,067 % éch. 31/12/2033	\$ 89	95
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 3,990 % éch. 15/10/2025	MYR 400	92	Empresas Publicas de Medellin ESP 8,375 % éch. 08/11/2027	COP 489 000	90
TES colombien 2,250 % éch. 18/04/2029	COP 473 632	91	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 589	64

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/06/2053	\$ 21 763	\$ 21 847	Obligation internationale du gouvernement philippin 5,500 % éch. 17/01/2048	\$ 1 500	\$ 1 560
EMF-UK PLC 5,970 % éch. 13/03/2046	£ 3 566	4 219	Viridis European Loan Conduit 5,724 % éch. 22/07/2029	£ 900	1 095
TDC Net A/S 5,618 % éch. 06/02/2030	€ 2 700	2 944	Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % éch. 21/01/2032	\$ 950	841
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (a)	\$ 2 547	2 455	Starwood Property Trust, Inc. 3,625 % éch. 15/07/2026	680	585
Great Hall Mortgages PLC 5,282 % éch. 18/06/2038	£ 2 040	2 387	Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong 5,250 % éch. 11/01/2053	500	546
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (a)	\$ 1 842	1 780	Clearway Energy Operating LLC 3,750 % éch. 15/02/2031	630	538
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 4,459 % éch. 25/01/2037	3 177	1 752	Verallia S.A. 1,625 % éch. 14/05/2028	€ 500	487
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (a)	1 702	1 654	Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % éch. 03/05/2028	\$ 600	482
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,161 % éch. 20/10/2051	£ 1 300	1 540	Prosus NV 3,061 % éch. 13/07/2031	600	469
Obligation internationale du gouvernement philippin 5,500 % éch. 17/01/2048	\$ 1 500	1 500	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % éch. 01/07/2029	500	448
Verizon Communications, Inc. 5,050 % éch. 09/05/2033	1 500	1 498	Verallia S.A. 1,875 % éch. 10/11/2031	€ 500	447
Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % éch. 01/04/2053	1 300	1 295	Transalta Corp. 7,750 % éch. 15/11/2029	\$ 400	421
KBC Group NV 5,796 % éch. 19/01/2029	1 250	1 250	Nokia Oyj 3,125 % éch. 15/05/2028	€ 400	419
Bridgeway Funding PLC 8,466 % éch. 16/10/2062	£ 950	1 091	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % éch. 24/09/2023	400	414
245 Park Avenue Trust 3,779 % éch. 05/06/2037	\$ 1 250	1 089	Radian Group, Inc. 6,625 % éch. 15/03/2025	\$ 400	399
Bridgeway Funding PLC 9,466 % éch. 16/10/2062	£ 950	1 087	Banco do Brasil S.A. 4,875 % éch. 11/01/2029	400	377
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/12/2052	\$ 1 099	1 065	DaVita, Inc. 3,750 % éch. 15/02/2031	400	323
Société Générale S.A. 6,691 % éch. 10/01/2034	1 000	1 004	Coty, Inc. 3,875 % éch. 15/04/2026	€ 300	317
Amgen, Inc. 5,600 % éch. 02/03/2043	900	895	Rexel S.A. 2,125 % éch. 15/12/2028	300	287
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,475 % éch. 22/02/2031	800	800	Owens Corning 3,950 % éch. 15/08/2029	\$ 300	286
CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % éch. 01/04/2053	800	799	Prosus NV 3,257 % éch. 19/01/2027	300	274
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (a)	817	799	Starwood Property Trust, Inc. 4,375 % éch. 15/01/2027	310	266
Intesa Sanpaolo SpA 6,625 % éch. 31/05/2033	£ 600	735	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
			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
			Greenko Power Ltd. 4,300 % éch. 13/12/2028	191	165
			BNP Paribas S.A. 2,871 % éch. 19/04/2032	200	164
			Owl Rock Capital Corp. 2,875 % éch. 11/06/2028	200	164
			MPT Operating Partnership LP 3,375 % éch. 24/04/2030	£ 200	150
			Fortune Brands Home & Security, Inc. 3,250 % éch. 15/09/2029	\$ 150	133

(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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	283 500	€ 27 505	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	833 400	€ 80 366
Union européenne			Nykredit Realkredit A/S		
2,750 % éch. 04/12/2037	€ 17 900	17 327	1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 392 712	37 100
Union européenne			Union européenne		
3,375 % éch. 04/10/2038	14 820	14 748	2,750 % éch. 04/12/2037	€ 17 900	16 736
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			Union européenne		
4,500 % éch. 01/10/2053	14 300	14 237	0,250 % éch. 22/04/2036	23 000	16 386
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	146 000	13 994	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	132 500	12 844
BMW Finance NV			Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		
3,609 % éch. 09/12/2024	€ 10 400	10 400	2,150 % éch. 01/09/2052	€ 19 000	12 014
Credit Mutuel Home Loan SFH S.A.			Kreditanstalt fuer Wiederaufbau		
3,250 % éch. 20/04/2029	9 700	9 669	0,000 % éch. 15/06/2029	11 100	9 311
Obligation internationale du gouvernement français			Obligation internationale du gouvernement français		
0,550 % éch. 01/03/2039	8 710	8 585	0,100 % éch. 25/07/2038	9 260	8 470
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation			Citigroup, Inc.		
0,125 % éch. 15/07/2024 (b)	\$ 7 361	6 606	4,412 % éch. 31/03/2031	\$ 8 100	7 254
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation			Obligation internationale du gouvernement espagnol		
0,500 % éch. 15/04/2024 (b)	7 289	6 561	2,550 % éch. 31/10/2032	€ 7 400	7 162
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation			Credit Mutuel Home Loan SFH S.A.		
0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	7 233	6 555	3,250 % éch. 20/04/2029	5 900	5 851
Obligation internationale du gouvernement espagnol			Obligation internationale du gouvernement espagnol		
0,000 % éch. 31/01/2028	€ 7 100	6 240	1,400 % éch. 30/07/2028	6 000	5 517
UniCredit SpA			Obligation internationale du gouvernement espagnol		
3,375 % éch. 31/01/2027	6 000	5 983	0,000 % éch. 31/01/2026	6 000	5 515
Union européenne			Électricité de France S.A.		
2,750 % éch. 05/10/2026	6 000	5 983	2,625 % éch. 01/12/2027	6 600	5 429
Hops Hill PLC			JAB Holdings BV		
0,000 % éch. 21/12/2055	£ 5 200	5 940	2,000 % éch. 18/05/2028	5 100	4 667
Toronto-Dominion Bank			Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		
3,879 % éch. 13/03/2026	€ 5 700	5 700	1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 47 800	4 595
Banco BPM SpA			Obligation internationale du gouvernement espagnol		
3,750 % éch. 27/06/2028	5 700	5 693	1,950 % éch. 30/04/2026	€ 4 600	4 487
Harvest CLO DAC			Nykredit Realkredit A/S		
3,907 % éch. 15/10/2030	5 676	5 578	1,500 % éch. 01/10/2053	DKK 42 300	4 191
Pierpont BTL PLC			Holding d'Infrastructures de Transport SASU		
0,000 % éch. 21/09/2054	£ 4 800	5 502	1,475 % éch. 18/01/2031	€ 4 900	4 030
Cassa Depositi e Prestiti SpA			Barclays PLC		
5,750 % éch. 05/05/2026	\$ 6 000	5 439	2,885 % éch. 31/01/2027	4 000	3 866
Red & Black Auto Lease France			Union européenne		
4,093 % éch. 27/06/2035	€ 5 400	5 400	0,750 % éch. 04/01/2047	6 100	3 628
Canada Square Funding PLC			Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		
5,316 % éch. 17/01/2059	£ 4 582	5 313	2,800 % éch. 01/03/2067	5 000	3 606
SCF Rahoituspalvelut DAC			Nexi SpA		
4,020 % éch. 25/06/2033	€ 5 300	5 300	1,625 % éch. 30/04/2026	3 797	3 484
Svensk Exportkredit AB			Banque européenne d'investissement		
3,250 % éch. 13/04/2026	5 300	5 299	0,250 % éch. 20/01/2032	4 200	3 341
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau			Dexia Credit Local S.A.		
2,875 % éch. 29/05/2026	5 200	5 182	0,500 % éch. 17/01/2025	3 500	3 327
Ginkgo Sales Finance			Union européenne		
4,113 % éch. 25/11/2049	5 150	5 149	0,000 % éch. 04/07/2031	4 200	3 321
Royal Bank of Canada			(a) Le Fonds Euro Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.		
3,607 % éch. 17/01/2025	5 000	5 000	(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.		
Credit Mutuel Home Loan SFH S.A.			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 du produit.		
3,125 % éch. 22/06/2027	4 900	4 888	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.		
Fédération des Caisses Desjardins du Québec			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.		
3,250 % éch. 18/04/2028	4 700	4 680			
Twin Bridges PLC					
5,715 % éch. 12/03/2055	£ 4 031	4 662			
Obligation internationale du gouvernement espagnol					
2,800 % éch. 31/05/2026	€ 4 500	4 490			
Oak No. 4 PLC					
0,000 % éch. 26/02/2065	£ 3 850	4 436			
Union européenne					
2,625 % éch. 04/02/2048	€ 4 700	4 133			
Revocar UG					
4,032 % éch. 21/04/2036	4 100	4 100			
Twin Bridges PLC					
5,525 % éch. 12/09/2055	£ 3 443	3 972			
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,841 % éch. 20/07/2045	2 821	3 289			
Autonoria FCT					

Variations importantes de la composition du portefeuille Fonds Euro Credit Fund

30 juin 2023

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Union européenne 0,000 % éch. 04/10/2030	€ 15 400	€ 12 406	UBS Group AG 1,250 % éch. 17/04/2025	€ 8 400	€ 8 126
Banque européenne d'investissement 2,250 % éch. 15/03/2030	12 800	12 294	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 78 904	7 577
Fonds européen de stabilité financière 3,000 % éch. 15/12/2028	11 000	10 940	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	74 128	7 479
Banque européenne d'investissement 0,050 % éch. 13/10/2034	12 700	9 141	Wells Fargo & Co. 1,000 % éch. 02/02/2027	€ 7 600	6 804
Union européenne 2,750 % éch. 04/02/2033	7 600	7 529	Nationwide Building Society 4,363 % éch. 01/08/2024	\$ 6 800	6 300
Région d'Île de France 3,050 % éch. 03/02/2033	7 200	7 183	UBS Group AG 1,250 % éch. 17/07/2025	€ 6 900	6 238
Obligation internationale du gouvernement roumain 6,625 % éch. 27/09/2029	6 400	6 606	Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % éch. 05/09/2027	5 300	5 178
Union européenne 0,000 % éch. 04/11/2025	6 700	6 204	Cooperatieve Rabobank UA 4,000 % éch. 10/01/2030	5 100	5 141
Union européenne 1,500 % éch. 04/10/2035	7 400	6 189	Barclays PLC 0,577 % éch. 09/08/2029	6 400	5 126
Union européenne 0,400 % éch. 04/02/2037	8 900	6 130	Logicor Financing SARL 2,250 % éch. 13/05/2025	5 500	5 039
Mécanisme européen de stabilité 0,750 % éch. 15/03/2027	6 700	6 118	BNP Paribas S.A. 0,500 % éch. 04/06/2026	5 400	5 021
Fonds européen de stabilité financière 1,250 % éch. 24/05/2033	7 000	6 103	Cariyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 3,927 % éch. 15/07/2030	4 887	4 810
Union européenne 0,450 % éch. 04/07/2041	9 700	6 092	NatWest Group PLC 2,000 % éch. 04/03/2025	4 900	4 798
Fonds européen de stabilité financière 2,375 % éch. 11/04/2028	6 300	6 091	Worldline S.A. 1,625 % éch. 13/09/2024	4 800	4 645
Banque européenne d'investissement 0,250 % éch. 20/01/2032	7 500	6 088	CaixaBank S.A. 3,750 % éch. 07/09/2029	4 500	4 509
BNG Bank NV 3,000 % éch. 11/01/2033	6 000	5 997	Global Switch Holdings Ltd. 1,500 % éch. 31/01/2024	4 600	4 507
Union européenne 2,750 % éch. 04/12/2037	6 200	5 964	InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % éch. 15/05/2027	4 600	4 287
Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/05/2023	5 600	5 588	Stratton Mortgage Funding PLC 5,391 % éch. 20/07/2060	£ 3 724	4 236
Hamburg Commercial Bank AG 6,250 % éch. 18/11/2024	5 300	5 486	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % éch. 09/07/2027	€ 4 300	4 016
Cooperatieve Rabobank UA 4,000 % éch. 10/01/2030	5 100	5 078	ING Groep NV 3,000 % éch. 18/02/2026	£ 3 600	3 847
Cooperatieve Rabobank UA 4,655 % éch. 22/08/2028	\$ 5 200	4 636	Standard Chartered PLC 1,214 % éch. 23/03/2025	\$ 3 800	3 377
Werfen S.A. 4,625 % éch. 06/06/2028	€ 4 600	4 560	Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % éch. 13/09/2029	€ 4 200	3 375
Province du Québec 3,000 % éch. 24/01/2033	4 200	4 161	Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % éch. 09/05/2029	4 100	3 349
Verizon Communications, Inc. 4,750 % éch. 31/10/2034	3 600	3 752	ORIX Corp. 4,477 % éch. 01/06/2028	3 300	3 322
American Tower Corp. 4,625 % éch. 16/05/2031	3 500	3 478	Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 31 738	3 227
Morgan Stanley 5,123 % éch. 01/02/2029	\$ 3 600	3 333	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 7,375 % éch. 15/09/2029	€ 3 100	3 115
ORIX Corp. 4,477 % éch. 01/06/2028	€ 3 300	3 300	AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % éch. 06/02/2027	3 100	3 091
			Obligation internationale du gouvernement roumain 6,625 % éch. 27/09/2029	3 000	3 077
			Charter Communications Operating LLC 6,795 % éch. 01/02/2027	\$ 3 300	3 056
			Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % éch. 29/03/2028	€ 3 400	3 056
			UBS Group AG 4,282 % éch. 09/01/2028	\$ 3 600	3 053
			Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % éch. 22/06/2026	3 240	3 021
			Syngenta Finance NV 3,375 % éch. 16/04/2026	€ 3 100	2 988
			Cie Plastic Omnium S.A. 1,250 % éch. 26/06/2024	3 000	2 892
			DAE Funding LLC 1,625 % éch. 15/02/2024	\$ 3 200	2 883
			Deutsche Bank AG 0,750 % éch. 17/02/2027	€ 3 200	2 835
			Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % éch. 17/03/2026	3 000	2 791

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023 (suite)		
QNB Finance Ltd. 1,375 % éch. 26/01/2026	\$ 3 300	€ 2 750
Nordea Kredit Realkreditatieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 26 040	2 647
TDF Infrastructure SASU 1,750 % éch. 01/12/2029	€ 3 200	2 594

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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Jupiter Mortgage PLC 5,891 % éch. 20/07/2060	£ 24 700	€ 27 420	Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/03/2023	€ 21 750	€ 21 715
Bridgeway Funding PLC 6,716 % 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 4,168 % 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 4,439 % éch. 24/06/2071	15 000	14 787	HSBC Holdings PLC 1,589 % éch. 24/05/2027	\$ 17 500	14 307
Glenbeigh Issuer DAC 4,350 % éch. 24/06/2050	14 848	14 629	Loxam S.A.S. 3,250 % éch. 14/01/2025	€ 14 600	13 966
Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/03/2023	14 600	14 550	ACTIONS		
Barclays PLC 7,437 % éch. 02/11/2033	\$ 12 226	12 596	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	137 900	13 231
Tower Bridge Funding PLC 5,991 % éch. 20/10/2064	£ 10 400	11 876		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
NatWest Group PLC 6,016 % éch. 02/03/2034	\$ 11 900	11 225	Syngenta Finance NV 3,375 % éch. 16/04/2026	€ 13 600	13 148
BPCE S.A. 5,748 % éch. 19/07/2033	12 100	11 072	Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % éch. 09/10/2025	14 000	13 108
Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % éch. 15/01/2033	11 700	11 005	Banco de Sabadell S.A. 1,125 % éch. 27/03/2025	14 000	12 872
HSBC Holdings PLC 5,402 % éch. 11/08/2033	12 000	10 902	Deutsche Bank AG 1,625 % éch. 20/01/2027	14 200	12 616
Atrium Hotel Portfolio Trust 7,093 % éch. 15/06/2035	9 700	8 681	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 112 167	11 274
Option One Mortgage Loan Trust 5,330 % éch. 25/04/2037	13 654	7 290	Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % éch. 15/01/2033	\$ 11 700	10 992
Société Générale S.A. 6,446 % éch. 10/01/2029	7 200	6 821	Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % éch. 17/03/2026	€ 11 400	10 717
UBS Commercial Mortgage Trust 6,693 % éch. 15/02/2032	7 520	6 700	Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028	11 500	9 831
KBC Group NV 5,796 % éch. 19/01/2029	7 200	6 695	Société Générale S.A. 2,226 % éch. 21/01/2026	\$ 11 000	9 624
UBS Group AG 7,750 % éch. 01/03/2029	€ 6 400	6 664	IHO Verwaltungs GmbH 3,625 % éch. 15/05/2025	€ 10 200	9 614
Harbour Energy PLC 5,457 % éch. 28/01/2054	£ 5 700	6 300	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % éch. 09/07/2027	10 500	9 562
Stratton Mortgage Funding PLC 6,991 % éch. 20/07/2060	5 594	6 204	Accor S.A. 2,375 % éch. 29/11/2028	9 600	8 237
Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/05/2023	€ 5 380	5 368	TP ICAP Finance PLC 2,625 % éch. 18/11/2028	£ 8 600	7 779
Soundview Home Loan Trust 6,150 % éch. 25/09/2037	\$ 7 944	5 244	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 75 223	7 222
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % éch. 21/11/2033	4 950	4 927	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % éch. 15/02/2025	\$ 7 700	6 689
Ludgate Funding PLC 3,212 % éch. 01/01/2061	€ 5 062	4 807	UBS Group AG 1,250 % éch. 17/07/2025	€ 7 000	6 682
IndyMac Mortgage Loan Trust 5,770 % éch. 25/10/2036	\$ 9 569	4 740	WPC Eurobond BV 1,350 % éch. 15/04/2028	7 000	5 922
Pacific Gas & Electric Co. 6,100 % éch. 15/01/2029	5 000	4 657	Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % éch. 13/09/2029	7 500	5 899
Pacific Gas & Electric Co. 6,400 % éch. 15/06/2033	5 000	4 655	Sofina S.A. 1,000 % éch. 23/09/2028	7 400	5 819
Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % éch. 25/03/2035	5 570	4 583	Grifols S.A. 5,633 % éch. 15/11/2027	6 000	5 705
RMAC Securities PLC 5,254 % éch. 12/06/2044	£ 4 276	4 517	Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 7,396 % éch. 01/12/2027	\$ 5 670	5 170
Fremont Home Loan Trust 5,270 % éch. 25/01/2037	\$ 10 545	4 497	Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,250 % éch. 22/03/2030	€ 6 000	5 141
Option One Mortgage Loan Trust 5,250 % éch. 25/07/2036	10 720	4 451	KBC Group NV 5,796 % éch. 19/01/2029	\$ 5 200	4 878
HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,525 % éch. 25/05/2037	4 600	4 109	INEOS Finance PLC 6,168 % éch. 08/11/2028	€ 5 000	4 761
			AA Bond Co. Ltd. 5,500 % éch. 31/07/2050	£ 4 510	4 650

(a) Le Fonds Euro Income 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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)	
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023			
Obligation internationale du gouvernement français 4,500 % éch. 25/04/2041	€ 47 000	€ 55 092	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	116 900	€ 11 213	
Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/10/2038	34 500	37 869		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement français 2,500 % éch. 25/05/2043	27 700	24 485		Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052	€ 19 500	10 161
Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/04/2060	17 900	20 809		Obligation internationale du gouvernement français 2,500 % éch. 25/05/2043	7 600	6 516
Obligation internationale du gouvernement français 3,250 % éch. 25/05/2045	20 400	20 520		Obligation internationale du gouvernement français 2,000 % éch. 25/05/2048	6 450	4 951
Obligation internationale du gouvernement français 3,000 % éch. 25/05/2054	18 900	17 701		Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/04/2055	2 800	3 104
ACTIONS				Obligation internationale du gouvernement français 3,250 % éch. 25/05/2045	3 100	3 063
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	179 500	17 243		République d'Allemagne 2,500 % éch. 15/08/2046	2 900	2 874
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 26 741	2 518
Obligation internationale du gouvernement néerlandais 2,750 % éch. 15/01/2047	€ 13 700	13 989		Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/06/2039	€ 2 850	2 405
Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052	23 200	12 774	Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 30/01/2026	£ 1 900	1 954	
République d'Allemagne 4,750 % éch. 04/07/2040	9 300	12 149	Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/04/2060	€ 1 650	1 855	
Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/04/2055	10 200	11 639	Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 3,250 % éch. 12/01/2043	1 500	1 405	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)	\$ 10 338	9 366	Obligation internationale du gouvernement français 0,500 % éch. 25/06/2044	2 000	1 235	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	8 703	7 846	Obligation internationale du gouvernement français 0,500 % éch. 25/05/2072	2 600	1 005	
Obligation internationale du gouvernement néerlandais 0,000 % éch. 15/01/2052	€ 16 000	7 816	Union européenne 0,300 % éch. 04/11/2050	1 800	853	
Obligation internationale du gouvernement français 1,500 % éch. 25/05/2050	11 300	7 724	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b)	\$ 964	808	
Obligation internationale du gouvernement néerlandais 0,000 % éch. 15/01/2038	11 300	7 608	Obligation internationale du gouvernement français 1,500 % éch. 25/05/2050	€ 1 100	780	
République d'Allemagne 2,500 % éch. 15/08/2046	7 300	7 477	Nykredit Realkredit A/S 3,500 % éch. 01/10/2053	DKK 6 011	741	
Obligation internationale du gouvernement français 2,000 % éch. 25/05/2048	8 200	6 391	Landmark Mortgage Securities PLC 4,865 % éch. 17/04/2044	£ 681	720	
Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2053	12 100	6 297	Banco Santander S.A. 2,375 % éch. 08/09/2027	€ 700	675	
Obligation internationale du gouvernement slovène 1,500 % éch. 25/03/2035	7 600	6 135				
Obligation internationale du gouvernement français 1,250 % éch. 25/05/2038	7 700	6 004	(a) Le Fonds Euro Long Average Duration Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.			
Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/05/2066	7 000	4 742	(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.			
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b)	\$ 5 103	4 549	Les variations importantes de portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total du produit. 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.			

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023 (suite)		
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2025 (a)	\$ 14 211	€ 12 578	Silver Arrow S.A. 3,768 % éch. 15/02/2030	€ 700	€ 700
Towd Point Mortgage Funding PLC 6,216 % éch. 20/02/2045	£ 2 997	3 513	Commerzbank AG 3,375 % éch. 12/12/2025	700	699
Westpac Banking Corp. 3,457 % éch. 04/04/2025	€ 1 500	1 500	CaixaBank S.A. 4,625 % éch. 16/05/2027	700	699
ING Bank NV 3,000 % éch. 15/02/2026	1 500	1 495	Realkredit Danmark A/S 2,860 % éch. 01/07/2023	DKK 5 200	698
Hana Bank 3,750 % éch. 04/05/2026	1 400	1 399	National Australia Bank Ltd. 5,507 % éch. 17/06/2026	£ 600	691
Burberry Group PLC 1,125 % éch. 21/09/2025	£ 1 100	1 150	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 3,602 % éch. 16/02/2026	€ 690	690
Heathrow Funding Ltd. 1,500 % éch. 12/10/2027	€ 1 200	1 143	Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025	700	680
Fortum Oyj 1,625 % éch. 27/02/2026	1 200	1 138	Harbour Energy PLC 5,358 % éch. 28/01/2054	£ 591	669
JAB Holdings BV 1,750 % éch. 25/06/2026	1 200	1 135	Svensk Exportkredit AB 3,250 % éch. 13/04/2026	€ 650	650
Thames Water Utilities Finance PLC 4,000 % éch. 19/06/2025	£ 1 000	1 120	Koninklijke Philips NV 0,500 % éch. 22/05/2026	700	641
Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % éch. 29/05/2026	€ 1 200	1 109	Chanel Ceres PLC 0,500 % éch. 31/07/2026	700	636
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,437 % éch. 04/04/2025	1 100	1 100			
Nationale-Nederlanden Bank NV 0,500 % éch. 10/10/2056	1 100	1 051			
ING Groep NV 0,125 % éch. 29/11/2025	1 100	1 025			
Royal Bank of Canada 3,607 % éch. 17/01/2025	1 000	1 000			
Toronto-Dominion Bank 3,650 % éch. 20/01/2025	1 000	1 000			
Banco Santander S.A. 3,375 % éch. 11/01/2026	1 000	999			
BNG Bank NV 0,050 % éch. 11/07/2023	1 000	999			
Cairn CLO DAC 3,842 % éch. 30/04/2031	986	965			
Stanlinton PLC 5,815 % éch. 12/06/2045	£ 816	920			
Harvest CLO DAC 3,907 % éch. 15/01/2031	€ 931	914			
Cars Alliance Auto Loans Germany 3,860 % éch. 18/03/2035	900	900			
Bank of Nova Scotia 3,704 % éch. 02/05/2025	900	900			
Lloyds Bank PLC 3,250 % éch. 02/02/2026	900	900			
Bank of Ireland Group PLC 0,750 % éch. 08/07/2024	900	899			
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 2,125 % éch. 10/06/2024	900	886			
Rochester Financing PLC 5,602 % éch. 18/12/2044	£ 790	883			
Stratton BTL Mortgage Funding PLC 5,221 % éch. 20/01/2054	779	868			
Bavarian Sky S.A. 3,765 % éch. 20/03/2030	€ 800	800			
Autonoria FCT 3,883 % éch. 26/01/2043	800	800			
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % éch. 06/04/2026	800	800			
Dilosk RMBS DAC 4,070 % éch. 20/07/2061	800	800			
Revocar UG 4,032 % éch. 21/04/2036	800	800			
Bavarian Sky UK PLC 5,407 % éch. 20/04/2031	£ 700	794			
Ginkgo Sales Finance 4,113 % éch. 25/11/2049	€ 749	749			
Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % éch. 05/05/2026	\$ 800	725			
BMW Finance NV 3,609 % éch. 09/12/2024	€ 700	700			

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023 (suite)		
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,550 % éch. 06/11/2023	€ 7 300	€ 7 183	ING Bank NV 3,000 % éch. 15/02/2026	€ 1 500	€ 1 491
Bank of China Ltd. 5,216 % éch. 10/08/2023	£ 5 000	5 616	Goldman Sachs Group, Inc. 3,750 % éch. 30/04/2024	1 500	1 490
Trinity Square PLC 5,316 % éch. 15/07/2059	4 441	5 003	Bank of Ireland Group PLC 1,375 % éch. 29/08/2023	1 500	1 489
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,635 % éch. 20/10/2051	3 629	4 256	(a) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.		
Bain Capital Euro CLO DAC 3,940 % éch. 20/01/2032	€ 3 800	3 717	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 du produit. 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.		
Korea Housing Finance Corp. 0,723 % éch. 22/03/2025	3 700	3 495	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.		
Precise Mortgage Funding PLC 6,065 % éch. 12/12/2055	£ 2 804	3 243			
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % éch. 09/07/2024	€ 3 200	3 113			
Becton Dickinson & 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			
Jubilee Place BV 4,027 % éch. 17/01/2059	2 899	2 884			
Canada Square Funding PLC 5,852 % éch. 17/06/2058	£ 2 535	2 814			
Lanebrook Mortgage Transaction PLC 5,141 % éch. 20/07/2058	2 512	2 802			
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % éch. 03/07/2025	€ 2 900	2 719			
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			
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2025 (a)	\$ 2 669	2 384			
Hops Hill PLC 6,204 % éch. 27/11/2054	£ 1 959	2 230			
Clydesdale Bank PLC 5,540 % éch. 22/03/2026	1 900	2 178			
Toronto-Dominion Bank 4,954 % éch. 22/04/2025	1 900	2 150			
Freddie Mac 0,800 % éch. 28/10/2026	\$ 2 600	2 137			
Société Générale S.A. 1,250 % éch. 15/02/2024	€ 2 100	2 059			
Freddie Mac 0,650 % éch. 27/10/2025	\$ 2 400	2 018			
Yorkshire Building Society 0,375 % éch. 11/04/2023	€ 2 000	1 993			
Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % éch. 15/09/2023	2 000	1 975			
Ripon Mortgages PLC 5,491 % éch. 28/08/2056	£ 1 636	1 876			
Teollisuuden Voima Oyj 2,125 % éch. 04/02/2025	€ 1 900	1 812			
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0,250 % éch. 17/03/2025	1 900	1 792			
Bank of Nova Scotia 3,050 % éch. 31/10/2024	1 800	1 790			
Obligation internationale du gouvernement polonais 0,000 % éch. 07/07/2023	1 800	1 786			
Caim CLO DAC 3,912 % éch. 31/01/2030	1 790	1 759			
Land Securities Capital Markets PLC 1,974 % éch. 08/02/2024	£ 1 500	1 698			
Nationwide Building Society 0,250 % éch. 22/07/2025	€ 1 800	1 664			
LeasePlan Corp. NV 0,125 % éch. 13/09/2023	1 600	1 568			
Korea Housing Finance Corp. 0,010 % éch. 05/02/2025	1 600	1 499			
Logicor Financing SARL 0,750 % éch. 15/07/2024	1 600	1 494			

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Ford Motor Credit Co. LLC 4,867 % éch. 03/08/2027	€ 4 150	€ 4 150	Ford Motor Credit Co. LLC 4,867 % éch. 03/08/2027	€ 4 150	€ 4 071
Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % éch. 17/06/2031	\$ 5 100	3 771	Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % éch. 17/06/2031	\$ 3 100	2 298
Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/03/2023	€ 3 090	3 078	Rolls-Royce PLC 4,625 % éch. 16/02/2026	€ 2 100	2 061
Pinnacle Bidco PLC 6,375 % éch. 15/02/2025	£ 2 800	2 991	Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % éch. 15/08/2024	1 900	1 865
Spectrum Brands, Inc. 4,000 % éch. 01/10/2026	€ 3 000	2 874	Lottomatica SpA 7,125 % éch. 01/06/2028	1 800	1 853
			Cirsa Finance International SARL 4,750 % éch. 22/05/2025	1 800	1 761
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	29 500	2 826	Intrum AB 9,250 % éch. 15/03/2028	1 800	1 754
			Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/05/2023	1 700	1 698
			EP Infrastructure A/S 1,698 % éch. 30/07/2026	1 900	1 635
Rolls-Royce PLC 4,625 % éch. 16/02/2026	€ 2 600	2 559	INEOS Quattro Finance Plc 3,375 % éch. 15/01/2026	\$ 1 900	1 584
Électricité de France S.A. 6,000 % éch. 29/01/2026	£ 2 400	2 509	Summer BC Holdco SARL 5,750 % éch. 31/10/2026	€ 1 700	1 484
EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031	€ 3 400	2 431	BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % éch. 30/11/2028	1 500	1 251
Schaeffler AG 3,375 % éch. 12/10/2028	2 700	2 413	Inter Media and Communication SpA 6,750 % éch. 09/02/2027	1 300	1 225
Obligation internationale du gouvernement français 4,250 % éch. 25/10/2023	2 350	2 356	Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % éch. 08/06/2028	1 400	1 194
INEOS Quattro Finance PLC 2,500 % éch. 15/01/2026	2 500	2 270	EnQuest PLC 11,625 % éch. 01/11/2027	\$ 1 300	1 113
BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % éch. 30/11/2028	2 700	2 252	Rossini SARL 6,750 % éch. 30/10/2025	€ 1 000	1 011
Telecom Italia SpA 6,875 % éch. 15/02/2028	2 200	2 204	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % éch. 19/05/2025	1 000	935
Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % éch. 15/01/2030	£ 2 400	2 194	Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028	1 100	925
Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/05/2023	€ 2 150	2 145	Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 3,750 % éch. 15/01/2025	900	887
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£ 2 200	2 079	Virgin Money UK PLC 9,250 % éch. 08/06/2024	£ 800	863
Forvia 2,750 % éch. 15/02/2027	€ 2 200	1 970	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % éch. 31/03/2027	€ 1 000	850
Renault S.A. 2,375 % éch. 25/05/2026	2 100	1 929	Accor S.A. 2,375 % éch. 29/11/2028	900	811
Standard Industries, Inc. 2,250 % éch. 21/11/2026	2 100	1 841	Lloyds Banking Group PLC 8,500 % éch. 27/03/2028	£ 800	808
Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029	2 200	1 836	Loxam S.A.S. 3,250 % éch. 14/01/2025	€ 800	781
Lottomatica SpA 7,125 % éch. 01/06/2028	1 800	1 800			
Rolls-Royce PLC 3,375 % éch. 18/06/2026	£ 1 580	1 623	(a) Le Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.		
Chemours Co. 4,000 % éch. 15/05/2026	€ 1 700	1 581	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 du produit.		
Kronos International, Inc. 3,750 % éch. 15/09/2025	1 700	1 568	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.		
Commerzbank AG 8,625 % éch. 28/02/2033	£ 1 300	1 533	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.		
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % éch. 31/03/2027	€ 1 700	1 437			
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % éch. 12/11/2025	1 600	1 415			
ProGroup AG 3,000 % éch. 31/03/2026	1 500	1 410			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % éch. 02/03/2026	1 400	1 401			

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	157 000	€ 15 114	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	231 600	€ 22 258
	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 9,000 % éch. 01/11/2023	€ 2 200	2 296	Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	31 500	2 996
Obligation internationale du gouvernement espagnol 2,350 % éch. 30/07/2033	1 600	1 461	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050	28 880	2 744
République d'Allemagne 4,250 % éch. 04/07/2039	900	1 143	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % éch. 09/07/2024	€ 2 400	2 342
HSBC Holdings PLC 6,254 % éch. 09/03/2034	\$ 1 000	944	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9,000 % éch. 01/11/2023	2 200	2 293
Union européenne 0,300 % éch. 04/11/2050	€ 1 900	897	UniCredit SpA 7,830 % éch. 04/12/2023	\$ 2 050	1 879
AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % éch. 06/02/2027	900	897	Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 18 682	1 843
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025	900	873	Realkredit Danmark A/S 2,000 % éch. 01/10/2053	17 500	1 840
Santander UK Group Holdings PLC 6,534 % éch. 10/01/2029	\$ 800	754	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0,125 % éch. 15/09/2031	€ 2 300	1 831
Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 31/01/2046	£ 1 100	716	Realkredit Danmark A/S 3,000 % éch. 01/10/2053	DKK 13 600	1 619
Westpac Banking Corp. 3,457 % éch. 04/04/2025	€ 700	700	Crown European Holdings S.A. 2,625 % éch. 30/09/2024	€ 1 400	1 374
ING Belgium S.A. 3,375 % éch. 31/05/2027	700	699	Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025	1 200	1 194
Barclays PLC 7,437 % éch. 02/11/2033	\$ 600	606	Volkswagen Bank GmbH 1,875 % éch. 31/01/2024	1 200	1 184
Royal Bank of Canada 3,607 % éch. 17/01/2025	€ 600	600	Sparebanken Soer Boligkreditt A/S 3,125 % éch. 14/11/2025	1 100	1 101
Obligation internationale du gouvernement espagnol 3,550 % éch. 31/10/2033	590	590	Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,205 % éch. 15/11/2024	1 100	1 099
Deutsche Bank AG 3,875 % éch. 12/02/2024	£ 500	553	Charles Schwab Corp. 5,609 % éch. 13/05/2026	\$ 1 200	1 086
Banco Santander S.A. 3,727 % éch. 16/01/2025	€ 500	500	Deutsche Bank AG 4,000 % éch. 29/11/2027	€ 1 100	1 082
Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026	500	500	Royal Bank of Canada 4,784 % éch. 12/12/2025	\$ 1 100	1 023
Intesa Sanpaolo SpA 3,625 % éch. 30/06/2028	500	500	Sprint LLC 7,875 % éch. 15/09/2023	1 000	945
UniCredit SpA 3,375 % éch. 31/01/2027	500	499	AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % éch. 06/02/2027	€ 900	909
Virgin Money UK PLC 4,625 % éch. 29/10/2028	500	498	Union européenne 0,300 % éch. 04/11/2050	1 900	899
			Highland Holdings SARL 0,000 % éch. 12/11/2023	900	877
			Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % éch. 01/10/2050	DKK 8 700	864
			Nykredit Realkredit A/S 3,500 % éch. 01/10/2053	6 786	844
			UBS Group AG 1,250 % éch. 17/07/2025	€ 900	809
			Nykredit Realkredit A/S 2,000 % éch. 01/10/2053	DKK 7 200	789

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8 704 172	\$ 86 675	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8 365 588	\$ 83 300
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/10/2024	¥ 1 050 000	7 902	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028	CAD 5 500	4 137
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 20/04/2023	HUF 1 653 000	4 830	Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042	\$ 3 400	3 512
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 13/04/2023	1 647 000	4 747	Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2041	4 500	3 378
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028	CAD 5 500	4 134	Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,940 % éch. 12/02/2029	PEN 9 000	2 157
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 4,250 % éch. 10/12/2032	KRW 4 950 810	4 050	Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053	CAD 3 750	1 965
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b)	\$ 3 824	3 800	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033	2 180	1 554
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042	3 400	3 509	Obligation internationale du gouvernement marocain 2,000 % éch. 30/09/2030	€ 1 800	1 530
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b)	3 275	3 189	UBS Group AG 4,703 % éch. 05/08/2027	\$ 1 500	1 457
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b)	3 061	2 963	American Municipal Power, Inc. 7,334 % éch. 15/02/2028	1 300	1 411
Obligation internationale du gouvernement bulgare 4,500 % éch. 27/01/2033	€ 2 100	2 219	Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/03/2028	1 400	1 399
Obligation internationale du gouvernement israélien 4,500 % éch. 17/01/2033	\$ 2 200	2 178	Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % éch. 27/09/2023	1 400	1 383
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033	KRW 2 805 850	2 105	Obligation internationale du gouvernement serbe 3,125 % éch. 15/05/2027	€ 1 400	1 376
Magyar Export-Import Bank 6,125 % éch. 04/12/2027	\$ 2 100	2 084	Madison Park Funding Ltd. 6,010 % éch. 15/04/2029	\$ 1 240	1 226
Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053	CAD 3 750	2 077	Citigroup, Inc. 3,785 % éch. 17/03/2033	1 300	1 157
Obligation internationale du gouvernement colombien 7,500 % éch. 02/02/2034	\$ 1 900	1 886	Petroleos Mexicanos 6,750 % éch. 21/09/2047	1 809	1 105
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033	CAD 2 180	1 551	Santander UK Group Holdings PLC 4,750 % éch. 15/09/2025	1 100	1 062
Obligation internationale du gouvernement hongrois 6,250 % éch. 22/09/2032	\$ 1 500	1 502	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2031 (b)	1 154	1 061
Gaci First Investment Co. 4,875 % éch. 14/02/2035	1 500	1 466	Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % éch. 22/02/2032	1 200	1 040
Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/03/2028	1 400	1 406	Boeing Co. 2,750 % éch. 01/02/2026	1 000	944

(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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 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)	
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	198 050
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	148 630
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031	223 959	148 531	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/09/2027	143 300	106 340
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 4,250 % éch. 10/12/2032	KRW 166 494 540	136 110	Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042	\$ 88 200	91 067
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/10/2024	¥ 17 912 450	134 182	Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2041	114 700	86 089
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/03/2024	15 550 000	120 544	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. 01/09/2027	CAD 143 300	106 280	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033	79 050	56 360
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b)	\$ 98 484	95 885	Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/03/2028	\$ 35 400	35 386
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b)	92 408	91 612	Boeing Co. 3,625 % éch. 01/02/2024	36 000	34 888
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042	88 200	91 022	CBAM Ltd. 6,370 % éch. 20/10/2029	27 151	26 947
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b)	90 376	87 460	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033	KRW 34 132 210	25 933
Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053	CAD 149 130	83 867	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,450 % éch. 17/06/2043	THB 793 970	25 139
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033	KRW 102 355 980	76 910	Prudential Funding Asia PLC 2,950 % éch. 03/11/2033	\$ 24 600	20 708
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/04/2024	¥ 8 140 000	62 516	Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % éch. 27/09/2023	20 000	19 754
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033	CAD 79 050	56 296	UBS Group AG 5,959 % éch. 12/01/2034	17 900	17 918
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/05/2024	¥ 5 580 000	42 040	BNP Paribas S.A. 2,591 % éch. 20/01/2028	19 553	17 341
Nykredit Realkredit A/S 5,000 % éch. 01/10/2053	DKK 250 000	35 975	Boeing Co. 3,625 % éch. 01/02/2031	19 000	16 986
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,520 % éch. 13/01/2028	\$ 35 700	35 700	Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % éch. 17/09/2030	18 200	15 925
Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/03/2028	35 400	35 551	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % éch. 17/09/2027	16 780	15 656
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,875 % éch. 18/07/2033	32 700	32 314			

- (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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023	¥ 16 560 000	\$ 129 911	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031	CAD 63 552	\$ 42 161
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/04/2053	\$ 51 995	51 858	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033	35 830	25 542
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/10/2024	¥ 6 820 000	51 185	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) 5,500 % éch. 01/05/2053	\$ 47 995	48 440	Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053	39 460	20 948
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031	CAD 63 552	42 126	Deutsche Bank AG 1,875 % éch. 23/02/2028	€ 12 300	11 827
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b)	\$ 34 323	34 153	Agence Française de Développement 2,875 % éch. 21/01/2030	9 000	9 644
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/03/2024	¥ 4 110 000	31 831	Communauté Française de Belgique 1,625 % éch. 03/05/2032	10 300	9 247
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033	KRW 36 353 420	27 444	Morgan Stanley 3,622 % éch. 01/04/2031	\$ 9 100	8 232
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b)	\$ 26 580	25 880	Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/03/2028	8 100	8 097
Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2023	DKK 180 000	25 801	Banque de développement asiatique 1,500 % éch. 04/05/2028	CAD 11 700	7 854
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033	CAD 35 830	25 510	Marks & Spencer PLC 3,750 % éch. 19/05/2026	£ 7 145	7 798
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/01/2053	\$ 24 453	24 989	Province de l'Ontario 1,550 % éch. 01/11/2029	CAD 11 600	7 486
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028	CAD 31 800	23 900	Goldman Sachs Group, Inc. 2,650 % éch. 21/10/2032	\$ 8 300	6 805
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 2,000 % éch. 10/06/2031	KRW 34 358 800	23 680	Région d'Île de France 3,050 % éch. 03/02/2033	€ 6 000	6 432
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b)	\$ 24 374	23 595	Obligation internationale du gouvernement japonais 0,200 % éch. 20/09/2032	¥ 750 000	5 839
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/04/2024	DKK 160 400	22 889	ACTIONS		
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/01/2053	\$ 21 826	22 365	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (a)	580 000	5 788
Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053	CAD 39 460	22 116	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 4,250 % éch. 10/12/2032	KRW 26 799 020	21 926	LeasePlan Corp. NV 0,250 % éch. 23/02/2026	€ 5 800	5 652
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,000 % éch. 30/10/2031	€ 20 000	21 914	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,450 % éch. 17/06/2043	THB 177 900	5 624
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/05/2053	\$ 18 618	18 790	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/12/2031	CAD 8 500	5 460
Hana Bank 3,750 % éch. 04/05/2026	€ 16 200	17 878	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2,875 % éch. 25/05/2027	€ 5 000	5 406
Communauté Française de Belgique 3,750 % éch. 22/06/2033	16 300	17 220	Région Wallonne Belgique 1,375 % éch. 06/04/2032	6 000	5 244
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/05/2053	\$ 17 198	17 153	BNP Paribas S.A. 3,132 % éch. 20/01/2033	\$ 6 300	5 174
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2028	¥ 2 127 708	16 469	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 2,500 % éch. 01/01/2052	5 819	5 019
			Santander UK Group Holdings PLC 4,750 % éch. 15/09/2025	5 000	4 827
			JPMorgan Chase & Co. 4,493 % éch. 24/03/2031	4 700	4 539
			Equinix, Inc. 2,500 % éch. 15/05/2031	5 500	4 456
			Derwent London PLC 1,875 % éch. 17/11/2031	£ 5 000	4 435
			HSBC Holdings PLC 1,500 % éch. 04/12/2024	€ 4 100	4 390
			Towd Point Mortgage Trust 6,150 % éch. 25/10/2059	\$ 4 310	4 289
			ZF Finance GmbH 2,000 % éch. 06/05/2027	€ 4 400	3 998
			BNP Paribas S.A. 5,198 % éch. 10/01/2030	\$ 4 150	3 996
			American Medical Systems Europe BV 0,750 % éch. 08/03/2025	€ 3 800	3 912
			Association internationale de développement 1,750 % éch. 05/05/2037	4 000	3 707
			Vonovia SE 0,750 % éch. 01/09/2032	4 900	3 619

(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 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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO			PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO		
US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023	¥ 2 880 000	22 593	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031	CAD 24 958	16 228
Obligation internationale du gouvernement chinois 2,440 % éch. 15/10/2027	CNY 149 740	21 921	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028	7 300	5 490
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 1,500 % éch. 01/06/2031	CAD 24 958	16 215	Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033	7 670	5 476
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/10/2024	¥ 1 320 000	9 878	Obligation internationale du gouvernement chinois 3,810 % éch. 14/09/2050	CNY 24 300	3 921
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 4,250 % éch. 10/12/2032	KRW 10 509 430	8 589	Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053	CAD 6 700	3 603
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b)	\$ 5 920	5 764	Obligation internationale du gouvernement canadien 2,000 % éch. 01/12/2051	6 150	3 455
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 3,500 % éch. 01/03/2028	CAD 7 300	5 487	Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,450 % éch. 17/06/2043	THB 109 900	3 392
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien 2,750 % éch. 01/06/2033	7 670	5 472	Oracle Corp. 2,300 % éch. 25/03/2028	\$ 2 400	2 143
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b)	\$ 5 487	5 312	Boeing Co. 2,750 % éch. 01/02/2026	2 100	1 980
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/04/2024	¥ 690 000	5 304	Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,350 % éch. 12/08/2028	PEN 7 900	1 954
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b)	\$ 5 339	5 302	Billets du Trésor américain 3,625 % éch. 31/03/2028	\$ 1 800	1 799
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033	KRW 6 805 960	5 118	Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % éch. 27/09/2023	1 800	1 778
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/03/2024	¥ 620 000	4 816	Commerzbank AG 5,125 % éch. 18/01/2030	€ 1 600	1 715
Obligation internationale du gouvernement canadien 1,750 % éch. 01/12/2053	CAD 7 750	4 378	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen 3,250 % éch. 10/06/2033	KRW 2 005 660	1 524
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 01/05/2024	¥ 310 000	2 336	Goldman Sachs Group, Inc. 1,375 % éch. 15/05/2024	€ 1 400	1 486
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,885 % éch. 15/08/2029	MYR 10 179	2 335	Obligation du gouvernement chinois 3,720 % éch. 12/04/2051	CNY 9 300	1 480
Barclays PLC 6,224 % éch. 09/05/2034	\$ 2 300	2 300	IHO Verwaltungs GmbH 8,750 % éch. 15/05/2028	€ 1 300	1 433
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,875 % éch. 18/07/2033	2 200	2 174	CaixaBank S.A. 3,625 % éch. 14/09/2028	1 800	1 426
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,750 % éch. 18/01/2028	1 900	1 893	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 12 750	1 389

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11 209 301	\$ 111 622	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	13 127 486	\$ 130 726
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	99 700	9 875
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b)	\$ 39 930	39 441		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
	ACTIONS		Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,700 % éch. 01/09/2030	CLP 5 200 000	5 986
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Capital Securities Fund (a)	725 222	7 476	Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 80 350	4 961
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	65 900	6 543	TES colombien 13,250 % éch. 09/02/2033	COP 14 473 700	3 332
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			ACTIONS	
TES colombien 13,250 % éch. 09/02/2033	COP 14 473 700	3 210	Oak Street Health, Inc.	87 200	3 036
	ACTIONS		Horizon Therapeutics PLC	26 500	2 911
Oak Street Health, Inc.	87 200	3 074	Vertex Pharmaceuticals, Inc.	7 913	2 695
Citigroup, Inc.	61 100	2 864	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	3 435	2 627
Wells Fargo & Co.	71 700	2 817		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Bank of America Corp.	95 800	2 769	TES colombien 7,750 % éch. 18/09/2030	COP 13 677 500	2 619
JPMorgan Chase & Co.	21 000	2 769		ACTIONS	
Radius Global Infrastructure, Inc.	93 700	1 362	TEGNA, Inc.	168 148	2 606
Sands China Ltd.	257 600	969	First Horizon Corp.	161 653	2 592
Galaxy Entertainment Group Ltd.	136 000	946	PNM Resources, Inc.	49 758	2 435
Wuliangye Yibin Co Ltd.	30 800	945	AMETEK, Inc.	16 956	2 430
H World Group Ltd.	20 000	945	Humana, Inc.	4 401	2 144
Li Ning Co Ltd.	101 000	945	Elevance Health, Inc.	4 621	2 120
Trip.com Group Ltd.	25 100	943		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
ANTA Sports Products Ltd.	62 800	941	Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % éch. 17/09/2030	\$ 2 100	1 859
Tencent Holdings Ltd.	19 100	938		ACTIONS	
China Resources Beer Holdings Co Ltd.	120 000	937	NetApp, Inc.	26 589	1 817
			MasTec, Inc.	17 777	1 689
			Eaton Corp. PLC	10 206	1 654

(a) Le Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation 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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	22 906 892	\$ 228 105	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	30 297 562	\$ 301 700
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Électricité de France S.A. 9,125 % éch. 15/03/2033	\$ 26 800	27 399	Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/11/2027	\$ 55 000	55 442
EP Infrastructure A/S 1,816 % éch. 02/03/2031	€ 28 500	22 495	Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/10/2027	28 000	27 928
Cidron Aida Finco SARL 5,000 % éch. 01/04/2028	17 500	17 159	Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 30/09/2027	20 000	20 048
United Group BV 3,625 % éch. 15/02/2028	17 330	14 710	Sprint Capital Corp. 8,750 % éch. 15/03/2032	10 000	12 236
Chrome Bidco SASU 3,500 % éch. 31/05/2028	11 900	10 661	Sprint LLC 7,625 % éch. 15/02/2025	10 000	10 255
Allegiant Travel Co. 7,250 % éch. 15/08/2027	\$ 10 500	10 461	Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025	10 000	9 865
Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % éch. 15/01/2030	£ 10 000	10 301	TMNL Holding BV 3,750 % éch. 15/01/2029	€ 10 000	9 485
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % éch. 15/01/2030	\$ 10 000	10 000	Virgin Media Finance PLC 3,750 % éch. 15/07/2030	10 000	8 789
Market Bidco Finco PLC 5,500 % éch. 04/11/2027	£ 10 300	9 958	Occidental Petroleum Corp. 8,875 % éch. 15/07/2030	\$ 5 625	6 435
Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029	€ 10 200	9 309	Global Medical Response, Inc. 6,500 % éch. 01/10/2025	10 000	6 050
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % éch. 01/06/2031	\$ 9 100	9 100	Verallia S.A. 1,875 % éch. 10/11/2031	€ 7 000	5 923
Cirsa Finance International SARL 4,500 % éch. 15/03/2027	€ 9 000	8 903	Western Midstream Operating LP 5,500 % éch. 01/02/2050	\$ 7 000	5 768
CT Investment GmbH 5,500 % éch. 15/04/2026	8 700	8 749	Occidental Petroleum Corp. 6,625 % éch. 01/09/2030	5 000	5 188
Medline Borrower LP 5,250 % éch. 01/10/2029	\$ 9 750	8 313	Occidental Petroleum Corp. 6,450 % éch. 15/09/2036	5 000	5 063
Kronos International, Inc. 3,750 % éch. 15/09/2025	€ 8 200	8 291	Accor S.A. 2,375 % éch. 29/11/2028	€ 5 000	4 897
Altice France S.A. 5,500 % éch. 15/01/2028	\$ 10 100	7 898	Occidental Petroleum Corp. 6,200 % éch. 15/03/2040	\$ 5 000	4 888
AMC Networks, Inc. 4,750 % éch. 01/08/2025	8 300	7 633	Cheniere Energy, Inc. 4,625 % éch. 15/10/2028	5 000	4 704
TK Elevator Midco GmbH 4,375 % éch. 15/07/2027	€ 7 400	7 303	United Group BV 3,125 % éch. 15/02/2026	€ 5 000	4 671
EQM Midstream Partners LP 4,500 % éch. 15/01/2029	\$ 8 050	7 249	Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % éch. 30/06/2029	5 000	4 265
Grifols S.A. 3,200 % éch. 01/05/2025	€ 6 500	6 819			
Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % éch. 15/10/2028	7 800	6 781			

(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 du produit. 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.

ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
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)		
	26 069 611	\$ 259 596		24 521 880	\$ 244 200
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b)	\$ 96 458	94 054	Obligations du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2052	\$ 130 500	105 970
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,750 % éch. 18/01/2028	52 000	51 820	Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/11/2051	98 021	64 452
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % éch. 15/01/2030	39 500	39 500	Obligations du Trésor américain 2,250 % éch. 15/02/2052	70 400	50 831
Amgen, Inc. 5,600 % éch. 02/03/2043	36 650	36 540	Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,350 % éch. 12/08/2028	PEN 98 387	24 496
UnitedHealth Group, Inc. 5,875 % éch. 15/02/2053	25 000	27 431	Aroundtown S.A. 5,375 % éch. 21/03/2029	\$ 31 800	24 377
Société Générale S.A. 6,691 % éch. 10/01/2034	26 900	27 019	Bevco Lux SARL 1,500 % éch. 16/09/2027	€ 23 000	22 536
NatWest Group PLC 6,016 % éch. 02/03/2034	25 900	25 900	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % éch. 11/01/2027	22 042	21 886
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,875 % éch. 18/07/2033	25 000	24 705	Crown Castle, Inc. 4,450 % éch. 15/02/2026	\$ 20 933	20 730
HCA, Inc. 5,500 % éch. 01/06/2033	22 550	22 535	MH Sub LLC 8,852 % éch. 13/09/2024	20 277	20 077
National Grid PLC 5,809 % éch. 12/06/2033	21 500	21 639	Las Vegas Sands Corp. 3,200 % éch. 08/08/2024	20 000	19 345
Kraft Heinz Foods Co. 4,375 % éch. 01/06/2046	25 000	21 137	American Tower Corp. 2,950 % éch. 15/01/2025	20 000	19 293
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5,110 % éch. 19/05/2043	18 100	17 738	Deutsche Bank AG 1,625 % éch. 20/01/2027	€ 18 600	18 199
Xcel Energy, Inc. 4,600 % éch. 01/06/2032	18 000	17 031	Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % éch. 30/09/2023	\$ 17 000	16 533
Duke Energy Corp. 3,850 % éch. 15/06/2034	€ 16 000	16 179	DAE Funding LLC 1,625 % éch. 15/02/2024	16 400	15 719
Obligation internationale du gouvernement canadien 2,000 % éch. 01/06/2028	CAD 22 300	15 706	Obligation internationale du gouvernement canadien 2,000 % éch. 01/06/2028	CAD 22 300	15 554
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % éch. 01/06/2028	\$ 14 700	14 700	Logicor Financing SARL 1,625 % éch. 15/07/2027	€ 17 550	15 535
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % éch. 01/06/2031	14 500	14 500	Carnival Corp. 7,168 % éch. 30/06/2025	13 966	14 902
UBS Group AG 4,750 % éch. 17/03/2032	€ 12 900	13 568	QNB Finance Ltd. 3,500 % éch. 28/03/2024	\$ 14 500	14 256
Comcast Corp. 5,350 % éch. 15/05/2053	\$ 13 100	13 044	MPT Operating Partnership LP 3,692 % éch. 05/06/2028	£ 17 262	14 179

- (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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 31/05/2025	\$ 30 800	\$ 30 734	Obligations du Trésor américain 1,750 % éch. 15/08/2041	\$ 37 750	\$ 26 484
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042	10 900	11 402	Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042	8 900	8 840
Arkea Home Loans SFH S.A. 3,250 % éch. 01/08/2033	€ 9 900	10 524	Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 15/10/2025	8 000	7 934
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/12/2052	\$ 9 993	9 686	Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042	6 200	5 617
Morgan Stanley 5,123 % éch. 01/02/2029	8 500	8 500	Nordea Bank Abp 1,500 % éch. 30/09/2026	6 100	5 329
Hana Bank 3,750 % éch. 04/05/2026	€ 7 500	8 282	Apple, Inc. 1,400 % éch. 05/08/2028	6 100	5 291
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/05/2053	\$ 8 513	8 216	Enel Finance International NV 4,625 % éch. 15/06/2027	5 400	5 243
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/05/2053	8 622	8 122	Zoetis, Inc. 2,000 % éch. 15/05/2030	6 100	5 067
Nederlandse Waterschapsbank NV 3,000 % éch. 20/04/2033	€ 6 500	7 124	Obligations du Trésor américain 2,250 % éch. 15/05/2041	6 500	4 949
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/06/2053	\$ 7 302	7 054	Obligation internationale du gouvernement israélien 4,500 % éch. 17/01/2033	4 400	4 237
Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/05/2043	7 100	6 958	Owens Corning 3,875 % éch. 01/06/2030	4 500	4 191
Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % éch. 01/04/2033	6 760	6 843	Forvia 2,750 % éch. 15/02/2027	€ 4 000	3 885
Morgan Stanley 6,342 % éch. 18/10/2033	6 000	6 524	Schaeffler AG 3,375 % éch. 12/10/2028	3 700	3 571
Région Wallonne Belgique 3,500 % éch. 15/03/2043	€ 5 800	6 140	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % éch. 15/06/2028	\$ 4 000	3 441
Land Securities Capital Markets PLC 4,875 % éch. 15/09/2034	£ 5 000	6 051	Trane Technologies Financing Ltd. 5,250 % éch. 03/03/2033	3 300	3 330
Truist Financial Corp. 4,873 % éch. 26/01/2029	\$ 6 000	6 000	Bank of Ireland Group PLC 6,253 % éch. 16/09/2026	3 250	3 238
PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % éch. 26/01/2027	5 880	5 880	Haleon U.S. Capital LLC 3,375 % éch. 24/03/2029	3 500	3 188
Bon du Trésor britannique 3,750 % éch. 22/10/2053	£ 4 700	5 788	Wells Fargo & Co. 4,540 % éch. 15/08/2026	3 100	3 055
JPMorgan Chase & Co. 4,912 % éch. 25/07/2033	\$ 5 600	5 547	Coöperatieve Rabobank UA 3,758 % éch. 06/04/2033	3 450	3 030
Barclays PLC 6,224 % éch. 09/05/2034	5 400	5 400	Open Text Corp. 6,900 % éch. 01/12/2027	2 900	2 996
			Banco de Sabadell S.A. 0,875 % éch. 16/06/2028	€ 3 400	2 925
			KBC Group NV 3,000 % éch. 25/08/2030	2 900	2 886
			Bank of Ireland Group PLC 1,875 % éch. 05/06/2026	2 900	2 884

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 du produit. 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.

ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
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)		
	26 568 216	\$		27 797 310	\$
					276 800
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)	\$ 43 057	43 717	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/04/2024 (b)	\$ 62 081	60 566
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2027	£ 27 902	35 555	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	47 987	47 126
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/01/2029 (b)	\$ 35 743	34 995	Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2026	£ 34 928	42 190
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/07/2028 (b)	35 666	34 516	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 0,250 % 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
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 0,125 % éch. 15/10/2024 (b)	25 502	24 609
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 0,375 % éch. 15/01/2027 (b)	20 687	19 531
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2026 (b)	22 665	21 458	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2025 (b)	19 026	18 112
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 0,500 % éch. 15/01/2028 (b)	17 942	16 952
Obligation internationale du gouvernement français 1,850 % éch. 25/07/2027	€ 13 761	15 973	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2023 (b)	15 350	15 273
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b)	\$ 15 257	14 989	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2026 (b)	15 829	15 082
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,400 % éch. 15/05/2039	€ 11 147	11 975	Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 22/10/2029	£ 11 400	11 573
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % éch. 26/05/2025	11 357	11 881	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/01/2029 (b)	\$ 9 970	9 417
Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 22/10/2029	£ 11 400	11 544	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2026 (b)	6 192	5 848
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2027 (b)	\$ 9 856	9 488	Ginnie Mae 5,946 % éch. 20/03/2073	5 716	5 657
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)	6 253	5 846	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2027 (b)	4 709	4 439
Ginnie Mae 5,866 % éch. 20/04/2073	5 700	5 643	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2025 (b)	4 602	4 415
Ginnie Mae 5,946 % éch. 20/03/2073	5 700	5 641	Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2038	€ 3 087	3 023
Ginnie Mae 6,067 % éch. 20/03/2073	5 700	5 631	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053	DKK 26 900	2 882

(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 du produit. 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.

ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
		PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	25 429 485 \$	253 215
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)	\$	56 233	53 359	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,400 % éch. 15/05/2039	€	40 068	43 047	
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031		29 778	31 546	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b)	\$	26 480	25 982	
Obligation internationale du gouvernement français 1,800 % éch. 25/07/2040	€	19 094	25 075	
Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 31/01/2029	£	22 500	23 421	
Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 22/10/2029		20 000	20 426	
Bon du Trésor britannique 0,625 % éch. 22/03/2045		16 400	20 327	
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 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)		14 043	13 726	
Bon du Trésor britannique 1,125 % éch. 22/11/2037	£	8 330	11 703	
Obligation internationale du gouvernement français 0,700 % éch. 25/07/2030	€	9 979	11 439	
Obligation internationale du gouvernement français 0,550 % éch. 01/03/2039		9 325	9 842	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/02/2047 (b)	\$	11 327	9 717	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)		8 600	8 737	
Bon du Trésor britannique 4,125 % éch. 22/07/2030	£	1 900	8 106	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b)	\$	8 079	8 046	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,000 % éch. 15/02/2048 (b)		9 134	7 987	
UniCredit SpA 3,375 % éch. 31/01/2027	€	7 000	7 463	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/04/2024 (b)	\$	7 676	7 459	
		PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	25 116 645 \$	250 100
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (b)	\$	68 906	68 858	
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031	€	43 474	47 179	
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2032	£	23 576	32 480	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)	\$	27 458	25 961	
Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 31/01/2029	£	22 500	23 404	
Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 22/10/2029		20 000	21 141	
Obligation internationale du gouvernement australien 3,000 % éch. 20/09/2025	AUD	20 720	20 475	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,550 % éch. 15/09/2041	€	16 901	19 055	
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	173 918	17 741	
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2044	£	11 238	12 436	
Bon du Trésor britannique 0,625 % éch. 22/11/2042		8 825	11 159	
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2038	€	9 945	9 741	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b)	\$	10 415	9 252	
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/10/2041	£	10 900	8 878	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/02/2045 (b)	\$	10 593	8 710	
Nykredit Realkredit A/S 0,500 % éch. 01/10/2053	DKK	85 800	8 582	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/02/2044 (b)		8 793	8 355	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2027 (b)		7 167	6 702	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b)		6 756	5 994	

(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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	92 073 080	\$ 916 871	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	51 790 752	\$ 515 700
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b)	\$ 589 185	572 494	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 3,500 % éch. 01/05/2052	\$ 450 387	417 289
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. 01/02/2053	220 992	228 485
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/06/2053	424 378	437 266	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/02/2053	138 941	143 630
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/02/2053	418 948	431 590	Obligation internationale du gouvernement russe 5,930 % éch. 24/04/2024	RUB 18 336 201	137 644
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/02/2053	415 453	423 328	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/03/2053	\$ 106 806	110 427
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/01/2053	415 060	421 079	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % éch. 19/05/2025	€ 102 118	108 139
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/04/2053	381 907	390 432	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/04/2053	\$ 89 372	92 388
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b)	392 865	378 114	Ginnie Mae 3,500 % éch. 20/09/2052	99 336	92 165
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/02/2053	366 898	377 741	Barclays PLC 7,125 % éch. 15/06/2025	£ 70 960	79 719
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b)	344 587	333 015	Boeing Co. 5,805 % éch. 01/05/2050	\$ 66 762	66 186
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/01/2053	309 361	318 345	ACTIONS Noble Corp. PLC	1 786 917	65 526
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/02/2053	306 748	312 487	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/01/2053	292 884	301 958	Netflix, Inc. 4,625 % éch. 15/05/2029	€ 58 400	64 385
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,500 % éch. 01/03/2053	287 921	295 749	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % éch. 22/06/2026	\$ 64 007	63 925
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/01/2053	256 730	260 624	Fannie Mae 6,500 % éch. 01/04/2053	61 117	63 189
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/01/2053	233 483	234 126	Mundys SpA 1,875 % éch. 12/02/2028	€ 68 400	63 002
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	222 145	217 394	Freddie Mac 3,000 % éch. 01/08/2037	\$ 63 747	61 123
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/06/2053	216 217	216 570	Petroleos Mexicanos 6,700 % éch. 16/02/2032	79 586	59 758
Billets du Trésor américain 0,625 % éch. 31/12/2027	230 260	199 477	Rolls-Royce PLC 4,625 % éch. 16/02/2026	€ 54 919	58 618
Credit Suisse AG 5,500 % éch. 20/08/2026	€ 179 400	190 721	SkyMiles IP Ltd. 8,798 % éch. 20/10/2027	\$ 55 315	57 312
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/03/2053	\$ 171 983	175 667			
Billets du Trésor américain 0,750 % éch. 31/01/2028	199 210	173 214			

(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 du produit. 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

30 juin 2023

ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
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)		
	6 072 281	\$ 60 466		5 483 190	\$ 54 600
DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)		DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)		
6,500 % éch. 01/02/2053	\$ 5 550	5 741	6,500 % éch. 01/02/2053	\$ 5 244	5 407
Billets du Trésor américain			Billets du Trésor américain		
3,875 % éch. 31/12/2027	4 600	4 640	4,125 % éch. 15/11/2032	4 200	4 462
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			Billets du Trésor américain		
4,000 % éch. 01/04/2053	4 800	4 490	3,875 % éch. 31/12/2027	3 000	3 064
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			Billets du Trésor américain		
5,500 % éch. 01/03/2053	4 000	4 022	2,750 % éch. 15/05/2025	2 500	2 453
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			Billets du Trésor américain		
4,500 % éch. 01/10/2052	3 800	3 706	4,000 % éch. 31/10/2029	1 700	1 729
Great Hall Mortgages PLC			Stratton Mortgage Funding PLC		
5,282 % éch. 18/06/2038	£ 2 960	3 436	6,991 % éch. 20/07/2060	£ 1 000	1 210
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			Billets du Trésor américain		
4,000 % éch. 01/03/2053	\$ 3 100	2 915	3,875 % éch. 30/09/2029	\$ 700	707
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			HSBC Holdings PLC		
3,500 % éch. 01/02/2053	3 182	2 906	6,254 % éch. 09/03/2034	600	624
Billets du Trésor américain			Eurosail PLC		
4,125 % éch. 15/11/2032	2 400	2 513	3,766 % éch. 15/12/2044	€ 504	531
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			UniCredit SpA		
5,000 % éch. 01/01/2053	2 479	2 470	3,875 % éch. 03/06/2027	500	382
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			Intesa Sanpaolo SpA		
6,000 % éch. 01/04/2053	1 798	1 829	5,875 % éch. 01/09/2031	300	255
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation			Dryden Euro CLO DAC		
0,125 % éch. 15/07/2024 (b)	1 539	1 495	3,987 % éch. 15/01/2032	239	251
Eurosail PLC			Mortimer BTL PLC		
3,919 % éch. 13/03/2045	€ 1 500	1 349	4,234 % éch. 21/06/2052	£ 200	245
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation			Huarong Finance Co. Ltd.		
0,250 % éch. 15/01/2025 (b)	\$ 1 274	1 227	3,375 % éch. 24/02/2030	\$ 300	237
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation			Segovia European CLO DAC		
0,125 % éch. 15/10/2024 (b)	1 247	1 205	4,080 % éch. 20/07/2032	€ 200	209
Stratton Mortgage Funding PLC			Obligation internationale du gouvernement russe		
6,991 % éch. 20/07/2060	£ 1 000	1 184	4,875 % éch. 16/09/2023	\$ 200	180
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation			Obligation internationale du gouvernement péruvien		
0,625 % éch. 15/07/2032 (b)	\$ 1 229	1 154	6,900 % éch. 12/08/2037	PEN 500	121
Billets du Trésor américain			Amgen, Inc.		
3,500 % éch. 31/01/2028	1 100	1 069	5,650 % éch. 02/03/2053	\$ 100	103
Jupiter Mortgage PLC			Obligation internationale du gouvernement sud-africain		
8,241 % éch. 20/07/2060	£ 900	1 002	10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 240	15

(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 du produit. 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

30 juin 2023

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	5 295 849	\$ 52 735	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	6 003 816	\$ 59 781
Invesco Physical Gold ETC	83 600	15 496		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		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	ACTIONS	73 541	13 892
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b)	7 374	7 251	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % éch. 15/05/2033	€ 6 158	5 442	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,125 % éch. 15/01/2033 (b)	\$ 7 428	7 171
Ginnie Mae 5,966 % éch. 20/01/2073	\$ 4 000	4 000	MRCD Mark Mortgage Trust 2,718 % éch. 15/12/2036	2 598	2 404
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % éch. 26/05/2025	€ 3 751	3 924	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/02/2045 (b)	2 675	2 212
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)	2 588	2 206
	ACTIONS		ACTIONS	9 670	1 709
Prologis, Inc.	9 840	1 180	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Equinix, Inc.	1 256	887	Invesco Physical Gold ETC	9 670	1 709
Public Storage	1 973	577		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Realty Income Corp.	9 136	576	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK 15 000	1 619
Simon Property Group, Inc.	5 099	555	Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	9 000	964
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (b)	\$ 480	476
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)	\$ 506	513	ACTIONS	2 872	453
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	511	499	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
	ACTIONS		Nationwide Building Society	2 872	453
Invitation Homes, Inc.	13 911	432		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
AvalonBay Communities, Inc.	2 440	405	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,000 % éch. 17/04/2025	\$ 380	371
Oak Street Health, Inc.	11 000	388	Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053	DKK 3 500	361
Gaming and Leisure Properties, Inc.	6 993	351	ACTIONS		
Digital Realty Trust, Inc.	3 384	348	Prologis, Inc.	2 857	357
			Horizon Therapeutics PLC	2 700	269
			Public Storage	896	266
			Seagen, Inc.	1 275	248
			Invitation Homes, Inc.	7 334	248
			Prometheus Biosciences, Inc.	1 200	238

(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 de portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 31/12/2024	\$ 183 100	\$ 183 157	Billets du Trésor américain 0,875 % éch. 31/01/2024	\$ 193 300	\$ 185 780
	ACTIONS		Billets du Trésor américain 1,500 % éch. 29/02/2024	190 000	183 439
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	16 160 879	160 926		ACTIONS	
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	16 399 070	163 300
Billets du Trésor américain 0,375 % éch. 31/01/2026	\$ 139 800	127 362		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
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 4,125 % éch. 31/01/2025	38 500	38 285	HSBC Holdings PLC 6,161 % éch. 09/03/2029	5 200	5 283
Billets du Trésor américain 0,250 % éch. 31/05/2025	27 900	25 815	JPMorgan Chase & Co. 4,851 % éch. 25/07/2028	4 300	4 284
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
Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026	€ 6 700	7 155	Global Payments, Inc. 4,950 % éch. 15/08/2027	3 800	3 719
HSBC Holdings PLC 6,161 % éch. 09/03/2029	\$ 5 200	5 200	ABN AMRO Bank NV 2,375 % éch. 01/06/2027	€ 3 600	3 694
Ginnie Mae 6,166 % éch. 20/05/2023	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
UBS Group AG 5,711 % éch. 12/01/2027	3 500	3 500	Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % éch. 15/03/2024	3 300	3 226
Palmer Square European Loan Funding DAC 4,727 % éch. 15/11/2032	€ 3 250	3 444	Deutsche Bank AG 1,000 % éch. 19/11/2025	€ 3 000	3 070
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,464 % éch. 13/01/2026	\$ 3 300	3 300	BPCE S.A. 5,975 % éch. 18/01/2027	\$ 2 900	2 900
BPCE S.A. 5,975 % éch. 18/01/2027	2 900	2 900	Daimler Truck Finance North America LLC 1,125 % éch. 14/12/2023	3 000	2 899
Amgen, Inc. 5,250 % éch. 02/03/2025	2 600	2 601	Mizuho Financial Group, Inc. 5,414 % éch. 13/09/2028	2 800	2 801
Billets du Trésor américain 0,875 % éch. 31/01/2024	2 500	2 403	Deutsche Bank AG 5,589 % éch. 08/11/2023	2 800	2 791
American Honda Finance Corp. 5,000 % éch. 23/05/2025	2 400	2 398	Chanel Ceres PLC 0,500 % éch. 31/07/2026	€ 2 800	2 690
National Bank of Canada 3,500 % éch. 25/04/2028	€ 2 000	2 191	Bank of America Corp. 4,587 % éch. 22/09/2026	2 400	2 609

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14 799 599	\$ 147 370	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14 229 718	\$ 141 700
	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 2,250 % éch. 31/03/2024	\$ 12 100	11 767
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 31/03/2025	16 500	16 504	SK on Co. Ltd. 5,375 % éch. 11/05/2026	3 900	3 890
Bon du Trésor britannique 1,625 % éch. 22/10/2028	£ 7 200	7 851	Société Générale S.A. 4,677 % éch. 15/06/2027	3 500	3 391
République d'Allemagne 2,500 % éch. 13/03/2025	€ 6 700	7 148	Ford Motor Credit Co. LLC 6,860 % éch. 05/06/2026	£ 2 500	3 115
Billets du Trésor américain 4,500 % éch. 15/11/2025	\$ 5 100	5 183	Volkswagen Financial Services AG 0,000 % éch. 12/02/2025	€ 2 700	2 635
Sika Capital BV 3,750 % éch. 03/11/2026	€ 3 800	4 169	Crédit Agricole S.A. 6,570 % éch. 22/03/2024	\$ 2 600	2 611
Santander Holdings USA, Inc. 6,499 % éch. 09/03/2029	\$ 4 000	4 000	American Airlines, Inc. 5,500 % éch. 20/04/2026	2 600	2 548
SK on Co. Ltd. 5,375 % éch. 11/05/2026	3 900	3 897	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % éch. 16/11/2025	2 500	2 438
Ford Motor Credit Co. LLC 6,860 % éch. 05/06/2026	£ 2 500	3 006	Syngenta Finance NV 3,375 % éch. 16/04/2026	€ 1 900	1 996
Morgan Stanley Bank N.A. 4,754 % éch. 21/04/2026	\$ 3 000	3 000	Lloyds Banking Group PLC 4,716 % éch. 11/08/2026	\$ 1 900	1 874
Black Hills Corp. 5,950 % éch. 15/03/2028	3 000	2 997	Standard Chartered PLC 7,767 % éch. 16/11/2028	1 700	1 850
Credit Suisse AG 7,950 % éch. 09/01/2025	3 000	2 994	Banco Santander S.A. 1,500 % éch. 14/04/2026	£ 1 700	1 823
BPCE S.A. 5,975 % éch. 18/01/2027	2 800	2 800	DAE Funding LLC 1,625 % éch. 15/02/2024	\$ 1 600	1 534
Kenvue, Inc. 5,500 % éch. 22/03/2025	2 600	2 615	International Flavors & Fragrances, Inc. 1,800 % éch. 25/09/2026	€ 1 400	1 373
BMW Canada, Inc. 4,760 % éch. 10/02/2025	CAD 3 500	2 601	Vantage Towers AG 0,000 % éch. 31/03/2025	1 300	1 341
Royal Bank of Canada 4,125 % éch. 05/07/2028	€ 2 300	2 499	Ford Motor Credit Co. LLC 3,021 % éch. 06/03/2024	1 100	1 168
Amgen, Inc. 5,250 % éch. 02/03/2025	\$ 2 500	2 498	Siemens Energy Finance BV 4,000 % éch. 05/04/2026	1 000	1 089
Mizuho Financial Group, Inc. 5,628 % éch. 13/06/2028	£ 2 100	2 493	QNB Finance Ltd. 3,500 % éch. 28/03/2024	\$ 1 100	1 082
ING Belgium S.A. 3,375 % éch. 31/05/2027	€ 2 300	2 474	Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % éch. 30/09/2023	1 100	1 070

(a) Le Fonds Low Duration Global Investment Grade 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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	6 309 071	\$ 62 826	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2 313 916	\$ 23 043
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Shamrock Residential DAC 4,289 % 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. 15/07/2024 (b)	\$ 17 535	17 051	Uber Technologies, Inc. 7,500 % éch. 15/05/2025	\$ 7 600	7 714
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b)	16 094	15 563	INEOS Finance PLC 7,463 % éch. 08/11/2027	€ 7 059	7 534
Shamrock Residential DAC 4,439 % éch. 24/06/2071	€ 14 000	14 549	American Airlines, Inc. 5,500 % éch. 20/04/2026	\$ 6 314	6 181
Dutch Property Finance BV 4,168 % éch. 28/04/2064	12 400	13 348	Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % éch. 15/04/2025	4 404	4 404
Shamrock Residential DAC 4,689 % éch. 24/02/2071	12 335	13 233	Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % éch. 01/01/2026	4 474	4 162
Harbour Energy PLC 5,457 % éch. 28/01/2054	£ 10 800	12 739	Sprint LLC 7,125 % éch. 15/06/2024	3 842	3 895
Twin Bridges PLC 0,000 % éch. 14/06/2055	10 000	12 427	Petco Health & Wellness Co., Inc. 1,000 % éch. 03/03/2028	3 767	3 738
Atlas Funding PLC 5,937 % éch. 20/01/2061	10 000	12 399	Bombardier, Inc. 7,500 % éch. 15/03/2025	3 108	3 108
Kinbane DAC 4,263 % éch. 25/09/2062	€ 11 522	12 268	SkyMiles IP Ltd. 8,798 % éch. 20/10/2027	2 992	3 100
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b)	\$ 8 421	8 109	Rolls-Royce PLC 4,625 % éch. 16/02/2026	€ 2 900	2 975
INEOS Finance PLC 7,463 % éch. 08/11/2027	€ 7 059	7 508	Uber Technologies, Inc. 8,000 % éch. 01/11/2026	\$ 2 585	2 646
T-Mobile USA, Inc. 4,800 % éch. 15/07/2028	\$ 7 000	6 985	Amgen, Inc. 5,150 % éch. 02/03/2028	2 600	2 644
Brants Bridge PLC 0,000 % éch. 14/06/2066	£ 5 300	6 649	Wynn Macau Ltd. 5,625 % éch. 26/08/2028	2 700	2 331
Adler Financing SARL 12,500 % éch. 30/06/2025	€ 5 771	5 902	VOC Escrow Ltd. 5,000 % éch. 15/02/2028	2 600	2 294
Saxon Asset Securities Trust 5,490 % éch. 25/10/2046	\$ 5 136	4 933	UBS AG 5,125 % éch. 15/05/2024	2 280	2 259
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	4 243	4 153	Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % éch. 10/08/2026	2 600	2 256
Credit Suisse AG 5,500 % éch. 20/08/2026	€ 3 200	3 402	PetSmart, Inc. 1,000 % éch. 11/02/2028	2 132	2 114
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b)	\$ 3 511	3 357	Ford Motor Credit Co. LLC 4,535 % éch. 06/03/2025	£ 1 801	2 071
NovaStar Mortgage Funding Trust 6,725 % éch. 25/12/2034	3 509	3 287	Wynn Las Vegas LLC 5,500 % éch. 01/03/2025	\$ 1 733	1 688
Société Générale S.A. 6,447 % éch. 12/01/2027	3 200	3 200	Sunshine Luxembourg SARL 9,092 % éch. 01/10/2026	1 716	1 685
			Sands China Ltd. 5,900 % éch. 08/08/2028	1 700	1 617
			Sands China Ltd. 2,800 % éch. 08/03/2027	1 700	1 483
			Broadcom, Inc. 3,469 % éch. 15/04/2034	1 764	1 456
			Weir Group PLC 2,200 % éch. 13/05/2026	1 600	1 419
			HSBC Holdings PLC 4,950 % éch. 31/03/2030	1 320	1 285

(a) Le Fonds Low Duration 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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	17 697 047	\$ 176 229	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20 194 397	\$ 201 100
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 20/04/2023	HUF 4 500 000	13 149	Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,350 % éch. 12/08/2028	PEN 29 700	7 351
Bons du Trésor hongrois 0,000 % éch. 13/04/2023	4 484 000	12 922	Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,940 % éch. 12/02/2029	27 500	6 597
Toronto-Dominion Bank 3,879 % éch. 13/03/2026	€ 8 000	8 543	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£ 5 200	5 309
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % éch. 31/03/2027	3 200	3 436	Southern California Edison Co. 2,750 % éch. 01/02/2032	\$ 5 900	5 034
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % éch. 06/04/2026	2 600	2 816	Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % éch. 17/09/2030	5 400	4 850
Virginia Electric and Power Co. 3,750 % éch. 15/05/2027	\$ 2 900	2 789	Zayo Group Holdings, Inc. 8,217 % éch. 09/03/2027	5 627	4 657
Goldman Sachs Group, Inc. 4,223 % éch. 01/05/2029	2 500	2 371	Lazard Group LLC 4,500 % éch. 19/09/2028	4 000	3 852
BPCE S.A. 4,625 % éch. 12/09/2028	2 500	2 352	Volkswagen Financial Services NV 1,125 % éch. 18/09/2023	£ 3 100	3 597
HSBC Holdings PLC 6,254 % éch. 09/03/2034	2 100	2 106	Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % éch. 15/03/2024	\$ 3 500	3 409
Duke Energy Progress LLC 5,250 % éch. 15/03/2033	2 000	2 041	HSBC Holdings PLC 2,999 % éch. 10/03/2026	3 600	3 395
Enbridge, Inc. 5,700 % éch. 08/03/2033	2 000	2 029	CenturyLink, Inc. 7,467 % éch. 15/03/2027	4 381	3 330
AES Corp. 5,450 % éch. 01/06/2028	2 000	1 978	Sagax AB 2,250 % éch. 13/03/2025	€ 2 900	3 004
American Tower Corp. 5,250 % éch. 15/07/2028	2 000	1 972	Kronos Acquisition Holdings, Inc. 1,000 % éch. 22/12/2026	\$ 2 542	2 465
Wells Fargo & Co. 4,808 % éch. 25/07/2028	2 000	1 959	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % éch. 17/09/2027	2 700	2 458
Humana, Inc. 3,700 % éch. 23/03/2029	2 000	1 844	Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % éch. 22/09/2026	€ 2 500	2 429
Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,400 % éch. 09/02/2028	1 700	1 697	U.S. Foods, Inc. 7,943 % éch. 22/11/2028	\$ 2 413	2 419
Bank of America Corp. 4,376 % éch. 27/04/2028	1 000	963	Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % éch. 15/10/2028	€ 2 700	2 273
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,242 % éch. 19/04/2029	600	600	United Airlines, Inc. 9,292 % éch. 21/04/2028	\$ 2 158	2 150
			OneMain Finance Corp. 6,125 % éch. 15/03/2024	2 150	2 102

(a) Le Fonds Low Duration Opportunities 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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 5,500 % éch. 09/03/2028	\$ 200	\$ 200
Weyerhaeuser Co. 4,750 % éch. 15/05/2026	36	36
AES Corp. 5,450 % éch. 01/06/2028	20	20

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Weyerhaeuser Co. 3,375 % éch. 09/03/2033	\$ 36	\$ 31
CommScope, Inc. 8,443 % éch. 06/04/2026	20	19
U.S. Foods, Inc. 7,943 % éch. 22/11/2028	16	16
CenturyLink, Inc. 7,467 % éch. 15/03/2027	20	15

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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Kinder Morgan, Inc.	125 600	\$ 2 292	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	361 531	\$ 3 600
Antero Midstream Corp.	107 900	1 154	Equitrans Midstream Corp.	387 682	3 424
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	112 068	1 116	Enbridge, Inc.	62 400	2 421
ONEOK, Inc.	12 000	825	TC Energy Corp.	44 000	1 781
Hess Midstream LP « A »	22 700	613	Pembina Pipeline Corp.	52 900	1 753
			Chesapeake Energy Corp.	19 000	1 544
			Pioneer Natural Resources Co.	6 200	1 333
			Diamondback Energy, Inc.	7 800	1 070
			Williams Cos., Inc.	32 100	1 004
			EnLink Midstream LLC	67 500	844
			Cheniere Energy, Inc.	5 000	765
			Targa Resources Corp.	9 700	731
			Antero Resources Corp.	26 400	704
			ONEOK, Inc.	10 400	598
			EQT Corp.	14 100	444
			ConocoPhillips	2 300	232

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 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
Freddie Mac 4,500 % éch. 01/02/2053	198 454	190 027	Freddie Mac 4,500 % éch. 01/02/2053	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	100 000	98 254	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/01/2053	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) 4,000 % éch. 01/12/2052	99 248	94 999
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/01/2053	98 116	96 035	Fannie Mae 4,500 % éch. 01/10/2052	97 237	93 138
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	85 000	81 882
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,000 % éch. 01/05/2053	94 223	88 632	Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/02/2053	74 655	75 424
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/02/2053	74 655	75 696	Freddie Mac 4,500 % éch. 01/01/2053	74 876	73 347
Freddie Mac 4,500 % éch. 01/01/2053	74 876	73 569	Fannie Mae 3,000 % éch. 01/06/2051	21 807	20 043
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/03/2053	49 662	47 553	Fannie Mae 3,000 % éch. 01/06/2051	21 386	19 656
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/05/2053	14 926	14 880	Fannie Mae 3,000 % éch. 01/12/2050	15 540	14 283
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 6,000 % éch. 01/05/2053	10 945	11 158	Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 6,404 % éch. 21/10/2028	£ 11 400	14 067
Ginnie Mae 3,500 % éch. 20/10/2052	8 500	7 872	Trinity Square PLC 5,866 % éch. 15/07/2059	9 600	11 671
Chester B1 Issuer PLC 5,766 % éch. 17/01/2058	£ 5 888	7 337	Ashford Hospitality Trust 7,419 % éch. 15/04/2035	\$ 12 000	11 475
Freddie Mac 4,660 % éch. 25/01/2031	\$ 2 200	2 200	Fannie Mae 3,000 % éch. 01/06/2051	11 638	10 697
Ginnie Mae 3,000 % éch. 20/04/2050	2 264	2 099	Stratton Mortgage Funding PLC 5,991 % éch. 20/07/2060	£ 8 100	9 955
Fannie Mae 4,500 % éch. 01/11/2032	2 000	2 021	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,440 % éch. 25/10/2047	\$ 10 000	8 588
Fannie Mae 4,374 % éch. 01/02/2028	2 000	1 990	Long Beach Mortgage Loan Trust 5,470 % éch. 25/10/2036	22 577	7 462

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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	7 918 177	\$ 78 848	Ripon Mortgages PLC 5,491 % éch. 28/08/2056	£ 12 228	\$ 14 381
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 6,245 % éch. 25/04/2036	\$ 11 300	10 622
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b)	\$ 31 988	31 148	ACTIONS		
Bumper FR 4,113 % éch. 27/04/2032	€ 14 200	15 378	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		
Jupiter Mortgage PLC 5,291 % éch. 20/07/2060	£ 11 540	14 424		863 561	8 600
LT Autorahoitus DAC 4,250 % éch. 17/12/2032	€ 12 869	14 113		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Silver Arrow Athlon NL BV 4,139 % éch. 26/04/2031	12 757	13 805	Taurus FR DAC 4,787 % éch. 22/12/2030	€ 7 079	7 500
LT Autorahoitus DAC 4,040 % éch. 18/07/2033	10 400	11 371	Stratton Mortgage Funding PLC 5,565 % éch. 12/12/2043	£ 5 578	6 521
Billets du Trésor américain 0,625 % éch. 30/11/2027	\$ 12 800	11 112	Logicor Financing SARL 2,250 % éch. 13/05/2025	€ 6 000	5 851
Tower Bridge Funding PLC 5,399 % éch. 21/07/2064	£ 7 994	10 073	Quanta Services, Inc. 0,950 % éch. 01/10/2024	\$ 6 300	5 813
Hill FL BV 4,050 % éch. 18/05/2030	€ 8 544	9 360	Frost CMBS DAC 4,533 % éch. 20/11/2033	€ 4 870	4 967
Twin Bridges PLC 5,635 % éch. 01/12/2055	£ 7 588	9 321	Aroundtown S.A. 5,375 % éch. 21/03/2029	\$ 6 500	4 696
Billets du Trésor américain 0,625 % éch. 31/12/2027	\$ 10 700	9 269	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,440 % éch. 25/10/2047	5 400	4 686
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 4,200 % éch. 15/07/2046	9 084	9 039	Hyatt Hotels Corp. 1,800 % éch. 01/10/2024	4 600	4 321
Toronto-Dominion Bank 4,701 % éch. 05/06/2027	9 000	9 000	Park Place Securities, Inc. 6,080 % éch. 25/05/2035	4 326	3 899
WFRBS Commercial Mortgage Trust 3,073 % éch. 15/06/2046	8 856	8 815	Deutsche Bank AG 1,375 % éch. 17/02/2032	€ 5 000	3 864
London Wall Mortgage Capital PLC 5,452 % éch. 15/05/2051	£ 6 695	8 227	Broadcom, Inc. 4,000 % éch. 15/04/2029	\$ 4 000	3 757
Hill FL BV 4,110 % éch. 18/05/2031	€ 7 400	8 129	Nomura Resecuritization Trust 6,050 % éch. 25/03/2037	3 691	3 567
Silver Arrow S.A. 3,768 % éch. 15/02/2030	7 245	7 926	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,430 % éch. 25/12/2046	3 353	3 068
Towd Point Mortgage Trust 3,750 % éch. 25/10/2056	\$ 8 100	7 642	RAMP Series Trust 5,510 % éch. 25/08/2046	3 188	2 879
UniCredit SpA 3,375 % éch. 31/01/2027	€ 6 200	6 610	JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,590 % éch. 25/07/2036	3 200	2 845
Nykredit Realkredit A/S 5,000 % éch. 01/10/2053	DKK 42 800	6 126	Option One Mortgage Loan Trust 5,280 % éch. 25/07/2037	4 220	2 767
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 3,602 % éch. 16/02/2026	€ 5 000	5 496	Long Beach Mortgage Loan Trust 6,065 % éch. 25/08/2035	3 000	2 674
Bank of Nova Scotia 3,050 % éch. 31/10/2024	5 000	5 453	Countrywide Alternative Loan Trust 5,347 % éch. 20/09/2046	2 718	2 636
Korea Housing Finance Corp. 0,010 % éch. 05/02/2025	5 000	5 123	Home Equity Asset Trust 5,450 % éch. 25/01/2037	2 936	2 525
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 4,218 % éch. 15/07/2046	\$ 5 150	5 111	European Loan Conduit DAC 4,358 % éch. 17/02/2030	€ 2 293	2 427
Korea Housing Finance Corp. 0,010 % éch. 07/07/2025	€ 5 000	5 051	Jackson National Life Global Funding 6,242 % éch. 28/06/2024	\$ 2 200	2 203
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 4,675 % éch. 15/06/2026	\$ 5 000	5 000	Fremont Home Loan Trust 5,765 % éch. 25/11/2035	2 400	2 085
Hops Hill PLC 0,000 % éch. 21/12/2055	£ 3 400	4 219	245 Park Avenue Trust 3,508 % éch. 05/06/2037	2 300	2 037
American Honda Finance Corp. 5,000 % éch. 23/05/2025	\$ 4 100	4 097	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 6,320 % éch. 25/03/2035	2 100	1 906
Ginkgo Sales Finance 4,113 % éch. 25/11/2049	€ 3 652	4 008	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 7,100 % éch. 25/08/2035	2 000	1 861
Barclays PLC 5,829 % éch. 09/05/2027	\$ 3 900	3 900	Credit Suisse Mortgage Capital Trust 1,115 % éch. 25/01/2060	2 174	1 819
			Credit Suisse Mortgage Capital Trust 2,688 % éch. 25/03/2059	1 674	1 622
			Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % éch. 17/09/2030	1 600	1 377

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	41 362	\$ 412	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20 084	\$ 200
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)	\$ 307	292	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,375 % éch. 15/02/2044 (b)	\$ 128	127
Palmer Square European Loan Funding DAC 4,727 % éch. 15/11/2032	€ 100	106	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)	103	97
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 4,200 % éch. 15/07/2046	\$ 100	100	VICI Properties LP 3,750 % éch. 15/02/2027	100	92
CSAIL Commercial Mortgage Trust 3,504 % éch. 15/06/2057	100	96	245 Park Avenue Trust 3,508 % éch. 05/06/2037	100	89
WFRBS Commercial Mortgage Trust 3,073 % éch. 15/06/2046	81	81	Warnermedia Holdings, Inc. 4,279 % éch. 15/03/2032	100	88
			Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053	DKK 71	8

(a) Le Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR 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 du produit. 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 Strategic Income Fund

30 juin 2023

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11 067 226	\$ 110 199	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11 709 681	\$ 116 600
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
UBS Group AG 5,959 % éch. 12/01/2034	\$ 3 458	3 463	INEOS Finance PLC 7,463 % éch. 08/11/2027	€ 4 307	4 591
	ACTIONS		GLP Capital LP 4,000 % éch. 15/01/2031	\$ 3 748	3 316
Coca-Cola Co.	53 447	3 227	Community Health Systems, Inc. 5,625 % éch. 15/03/2027	3 611	3 121
ConocoPhillips Co.	19 251	1 969		ACTIONS	
Amgen, Inc.	7 620	1 817	Philip Morris International, Inc.	27 716	2 584
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		Merck & Co., Inc.	21 585	2 361
Société Générale S.A. 6,691 % éch. 10/01/2034	\$ 1 800	1 806	Iberdrola S.A.	166 615	2 125
Amgen, Inc. 5,250 % éch. 02/03/2033	1 800	1 794	KDDI Corp.	65 000	2 055
Société Générale S.A. 6,446 % éch. 10/01/2029	1 700	1 700	General Dynamics Corp.	8 832	2 041
	ACTIONS		ConocoPhillips Co.	19 251	1 873
Unilever PLC	30 120	1 640		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		Amgen, Inc. 5,250 % éch. 02/03/2033	\$ 1 800	1 857
Billets du Trésor américain 0,625 % éch. 30/11/2027	\$ 1 860	1 615	Pacific Gas & Electric Co. 3,500 % éch. 15/06/2025	1 891	1 801
	ACTIONS		Petroleos Mexicanos 6,700 % éch. 16/02/2032	2 234	1 677
PACCAR, Inc.	21 032	1 603	Obligation internationale du gouvernement turc 4,250 % éch. 13/03/2025	1 800	1 667
Park Hotels & Resorts, Inc.	110 723	1 435		ACTIONS	
3M Co.	14 293	1 412	General Mills, Inc.	19 941	1 609
Kimberly-Clark Corp.	10 372	1 407	Exxon Mobil Corp.	14 569	1 560
Iberdrola S.A.	116 097	1 321		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
AbbVie, Inc.	9 122	1 319	Wynn Macau Ltd. 5,125 % éch. 15/12/2029	\$ 1 840	1 537
Valero Energy Corp.	10 385	1 318		ACTIONS	
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		Novartis AG	15 483	1 524
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	\$ 1 329	1 301		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
	ACTIONS		Obligation internationale du gouvernement russe 5,930 % éch. 24/04/2024	RUB 187 500	1 408
Holcim AG	20 846	1 291	Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 6,896 % éch. 15/01/2025	\$ 1 400	1 396
MediaTek, Inc.	49 000	1 201			

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	70 671 667	\$ 703 727	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	74 150 247	\$ 738 400
	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	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	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % éch. 15/01/2026	€ 15 000	15 832
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/06/2053	34 340	34 377	Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 28/02/2027	\$ 16 700	15 716
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2052	30 800	33 069	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 4,000 % éch. 15/11/2042	13 175	13 817
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b)	21 480	20 693	Logicor Financing SARL 2,250 % éch. 13/05/2025	€ 11 000	10 930
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,000 % éch. 01/05/2053	20 000	19 916	Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042	\$ 11 300	10 519
Ginnie Mae 5,966 % 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 1,250 % éch. 15/04/2028 (b)	13 951	13 543	Deutsche Bank AG 1,000 % éch. 19/11/2025	10 000	9 937
TP ICAP Finance PLC 7,875 % éch. 17/04/2030	£ 9 800	12 133	Digital Intrepid Holding BV 0,625 % éch. 15/07/2031	10 300	8 167
Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/05/2043	\$ 12 400	12 130	Equinix, Inc. 1,000 % éch. 15/09/2025	\$ 8 600	7 765
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. 4,231 % éch. 15/09/2060	10 900	10 574	Volkswagen Bank GmbH 1,875 % éch. 31/01/2024	€ 7 500	7 765
Benchmark Mortgage Trust 3,666 % éch. 15/01/2051	11 100	10 541	Syngenta Finance NV 3,375 % éch. 16/04/2026	7 000	7 358
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % éch. 15/01/2030	10 500	10 500	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % éch. 27/07/2029	7 400	6 531
Ginnie Mae 5,966 % éch. 20/01/2073	9 442	9 440	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,125 % éch. 04/09/2026	7 600	5 736
Mercedes-Benz Finance North America LLC 4,800 % éch. 30/03/2028	9 300	9 287	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,710 % éch. 13/01/2030	\$ 4 800	5 009
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 4,500 % éch. 01/05/2053	9 390	9 219	Deutsche Bank AG 1,375 % éch. 10/06/2026	€ 4 450	4 514

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14 253 620	\$ 141 935	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	13 426 751	\$ 133 700
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 17/04/2023	¥ 3 784 000	29 685			
CPPIB Capital, Inc. 6,338 % éch. 11/03/2026	\$ 11 000	11 240	CPPIB Capital, Inc. 6,338 % éch. 11/03/2026	\$ 11 000	11 238
Federal Home Loan Bank 5,370 % éch. 21/05/2024	8 500	8 500	Federal Home Loan Bank 5,370 % éch. 21/05/2024	8 500	8 499
Svensk Exportkredit AB 6,090 % éch. 23/02/2024	8 000	8 065	Svensk Exportkredit AB 6,090 % éch. 23/02/2024	8 000	8 049
Federal Home Loan Bank 5,350 % éch. 17/05/2024	8 000	8 000	Federal Home Loan Bank 5,350 % éch. 17/05/2024	8 000	7 998
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,400 % éch. 15/07/2031	5 996	5 939	Freddie Mac 5,375 % éch. 24/04/2025	4 300	4 300
Morgan Stanley 5,519 % éch. 25/01/2024	4 500	4 497	KeyBank N.A. 5,432 % éch. 03/01/2024	2 000	1 968
Freddie Mac 5,375 % éch. 24/04/2025	4 300	4 300	Gilead Sciences, Inc. 0,750 % éch. 29/09/2023	1 900	1 868
Toyota Motor Credit Corp. 5,569 % éch. 10/01/2025	4 200	4 200	Obligation internationale du gouvernement de l'Emirat d'Abou Dabi 0,750 % éch. 02/09/2023	1 500	1 480
Transpower New Zealand Ltd. 5,750 % éch. 28/08/2023	AUD 6 000	4 159	Huntington National Bank 6,280 % éch. 16/05/2025	1 100	1 055
Federal Home Loan Bank 5,360 % éch. 10/05/2024	\$ 4 000	4 000	Bank of Nova Scotia 0,550 % éch. 15/09/2023	1 000	983
Bank of America Corp. 3,550 % éch. 05/03/2024	4 000	3 994	Central Japan Railway Co. 3,400 % éch. 06/09/2023	900	894
RELX Capital, Inc. 3,500 % éch. 16/03/2023	4 000	3 992	Mercedes-Benz Finance North America LLC 5,500 % éch. 27/11/2024	800	808
Eni SpA 4,000 % éch. 12/09/2023	4 000	3 973	MassMutual Global Funding 5,068 % éch. 02/06/2023	800	800
Thermo Fisher Scientific, Inc. 5,562 % éch. 18/10/2024	3 800	3 798	Mitsubishi Corp. 3,375 % éch. 23/07/2024	600	588
Export-Import Bank of Korea 4,628 % éch. 30/10/2023	AUD 5 700	3 773	SK Hynix, Inc. 1,000 % éch. 19/01/2024	600	581
Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd. 3,100 % éch. 17/04/2023	5 000	3 547	Duke Energy Corp. 0,260 % éch. 10/06/2023	500	500
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,850 % éch. 25/03/2024	\$ 3 700	3 517	Province du Québec 5,520 % éch. 21/05/2024	500	500
National Bank of Canada 5,579 % éch. 06/08/2024	3 500	3 489	Cooperatieve Rabobank UA 1,980 % éch. 15/12/2027	500	445

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
Bon du Trésor britannique 1,625 % éch. 22/10/2028	£ 17 700	£ 15 897	Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 31/01/2023	£ 47 450	£ 47 365
Bon du Trésor britannique 3,500 % éch. 22/10/2025	14 900	14 650	ACTIONS		
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 30/01/2026	14 100	12 761	PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	51 000	5 189
Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/12/2049	4 600	4 754	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Bon du Trésor britannique 3,750 % éch. 22/10/2053	3 300	3 082	Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/12/2049	£ 4 300	4 656
Credit Suisse AG 7,750 % éch. 10/03/2026	1 900	1 897	HSBC Holdings PLC 2,625 % éch. 16/08/2028	1 400	1 270
Barclays PLC 6,369 % éch. 31/01/2031	1 800	1 807	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 1,125 % éch. 11/02/2027	1 400	1 252
Weir Group PLC 6,875 % éch. 14/06/2028	1 800	1 796	East Japan Railway Co. 1,162 % éch. 15/09/2028	1 500	1 230
CPPIB Capital, Inc. 6,000 % éch. 07/06/2025	1 700	1 698	Informa PLC 3,125 % éch. 05/07/2026	1 345	1 226
Royal Bank of Canada 5,000 % éch. 24/01/2028	1 700	1 696	Standard Chartered PLC 7,767 % éch. 16/11/2028	\$ 1 300	1 159
ENW Finance PLC 4,893 % éch. 24/11/2032	1 700	1 687	Rentokil Initial PLC 5,000 % éch. 27/06/2032	£ 1 200	1 121
Motability Operations Group PLC 4,875 % éch. 17/01/2043	1 500	1 495	MPT Operating Partnership LP 2,500 % éch. 24/03/2026	1 400	1 105
HSBC Holdings PLC 3,000 % éch. 22/07/2028	1 400	1 287	Hamburg Commercial Bank AG 6,250 % éch. 18/11/2024	€ 1 100	1 003
Lloyds Banking Group PLC 2,000 % éch. 12/04/2028	1 400	1 201	Deutsche Bank AG 1,875 % éch. 22/12/2028	£ 1 200	991
BP Capital Markets PLC 5,773 % éch. 25/05/2038	1 200	1 200	Northumbrian Water Finance PLC 6,375 % éch. 28/10/2034	950	969
Électricité de France S.A. 5,500 % éch. 25/01/2035	1 200	1 181	Oracle Corp. 6,150 % éch. 09/11/2029	\$ 1 100	954
National Grid Electricity Transmission PLC 5,272 % éch. 18/01/2043	1 100	1 100	UBS Group AG 7,375 % éch. 07/09/2033	£ 1 000	946
BNP Paribas S.A. 5,750 % éch. 13/06/2032	1 100	1 099	Commerzbank AG 8,625 % éch. 28/02/2033	900	905
Deutsche Bank AG 6,125 % éch. 12/12/2030	1 100	1 096	Heathrow Funding Ltd. 4,625 % éch. 31/10/2046	1 100	903
Heathrow Funding Ltd. 2,750 % éch. 09/08/2051	1 600	1 025	Citigroup, Inc. 4,500 % éch. 03/03/2031	1 000	892
			Deutsche Bank AG 6,125 % éch. 12/12/2030	900	877
			Bevco Lux SARL 1,000 % éch. 16/01/2030	€ 1 300	873

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 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
Bon du Trésor britannique 3,750 % éch. 22/10/2053	2 800	2 615	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % éch. 15/09/2026	3 400	3 047
British Telecommunications PLC 5,750 % éch. 13/02/2041	2 500	2 372	Deutsche Bank AG 1,875 % éch. 22/12/2028	3 600	2 982
Cooperatieve Rabobank UA 5,250 % éch. 23/05/2041	2 050	2 187	Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/12/2046	2 600	2 477
National Grid Electricity Transmission PLC 5,272 % éch. 18/01/2043	2 000	2 000	Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 31/07/2051	4 900	2 406
Walmart, Inc. 5,250 % éch. 28/09/2035	1 800	1 856	Bon du Trésor britannique 1,500 % éch. 22/07/2047	3 800	2 194
Électricité de France S.A. 5,625 % éch. 25/01/2053	1 900	1 846	Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/03/2036	1 900	1 962
Tesco Corporate Treasury Services PLC 5,500 % éch. 27/02/2035	1 800	1 785	Banque européenne d'investissement 6,000 % éch. 07/12/2028	1 700	1 877
National Gas Transmission PLC 5,750 % éch. 05/04/2035	1 850	1 778	Oracle Corp. 6,900 % éch. 09/11/2052	\$ 1 900	1 639
United Utilities Water Finance PLC 5,750 % éch. 26/06/2036	1 700	1 693	Bon du Trésor britannique 3,500 % éch. 22/01/2045	£ 1 900	1 635
Crédit Agricole S.A. 4,875 % éch. 23/10/2029	1 600	1 589	Crédit Agricole S.A. 4,875 % éch. 23/10/2029	1 600	1 596
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,750 % éch. 10/09/2042	1 800	1 509	Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % éch. 29/12/2049	€ 1 481	1 237
Walmart, Inc. 5,625 % éch. 27/03/2034	1 400	1 496	Virgin Money UK PLC 4,000 % éch. 03/09/2027	£ 1 235	1 108
Pfizer, Inc. 2,735 % éch. 15/06/2043	2 000	1 402	MPT Operating Partnership LP 3,692 % éch. 05/06/2028	1 400	1 039
Tesco Property Finance PLC 5,411 % éch. 13/07/2044	1 449	1 365	Citigroup, Inc. 3,878 % éch. 24/01/2039	\$ 1 500	1 006
Comcast Corp. 1,875 % éch. 20/02/2036	1 900	1 335	MPT Operating Partnership LP 3,375 % éch. 24/04/2030	£ 1 600	1 004
McDonald's Corp. 3,750 % éch. 31/05/2038	1 600	1 312	Cooperatieve Rabobank UA 5,250 % éch. 14/09/2027	1 050	995
Yorkshire Water Finance PLC 5,500 % éch. 28/04/2035	1 300	1 278	CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 2,625 % éch. 17/10/2034	1 350	916
Enel SpA 5,750 % éch. 22/06/2037	1 300	1 270	NatWest Group PLC 2,057 % éch. 09/11/2028	1 000	860
Tesco Property Finance PLC 5,744 % éch. 13/04/2040	1 220	1 211	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 du produit. 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.		
Diageo Finance PLC 2,750 % éch. 08/06/2038	1 600	1 204	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.		
Southern Water Services Finance Ltd. 3,000 % éch. 28/05/2037	1 700	1 200			
Clarion Funding PLC 1,875 % éch. 22/01/2035	1 600	1 116			
Motability Operations Group PLC 4,875 % éch. 17/01/2043	1 100	1 098			
Deutsche Telekom AG 3,125 % éch. 06/02/2034	1 300	1 064			
Gatwick Funding Ltd. 2,875 % éch. 05/07/2051	1 800	1 049			
Investor AB 5,500 % éch. 05/05/2037	1 000	1 023			

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	44 264 451	\$ 440 792	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	41 382 866	\$ 412 100
	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 4,250 % éch. 15/10/2025	\$ 23 000	22 700
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 31/12/2027	10 000	10 149	Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/11/2027	15 700	15 734
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % éch. 01/06/2031	10 100	10 100	Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025	10 000	9 865
Trident TPI Holdings, Inc. 12,750 % éch. 31/12/2028	9 750	9 647	Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/10/2027	9 000	9 006
Medline Borrower LP 5,250 % éch. 01/10/2029	10 750	9 297	Sprint Capital Corp. 8,750 % éch. 15/03/2032	7 000	8 565
Grifols Escrow Issuer S.A. 4,750 % éch. 15/10/2028	8 700	7 496	Heartland Dental LLC 8,500 % éch. 01/05/2026	9 000	8 010
Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % éch. 01/07/2031	6 250	6 164	Global Medical Response, Inc. 6,500 % éch. 01/10/2025	10 000	6 050
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % éch. 01/06/2028	6 000	6 000	White Cap Buyer LLC 6,875 % éch. 15/10/2028	6 800	6 001
American Airlines, Inc. 5,750 % éch. 20/04/2029	5 700	5 441	Sprint Capital Corp. 6,875 % éch. 15/11/2028	5 000	5 410
Triumph Group, Inc. 9,000 % éch. 15/03/2028	5 250	5 250	LBM Acquisition LLC 6,250 % éch. 15/01/2029	6 725	5 274
AMC Networks, Inc. 4,750 % éch. 01/08/2025	5 700	5 248	Park River Holdings, Inc. 5,625 % éch. 01/02/2029	7 000	5 140
Clarios Global LP 6,750 % éch. 15/05/2028	5 000	5 000	Sprint LLC 7,625 % éch. 15/02/2025	5 000	5 128
Albertsons Cos., Inc. 6,500 % éch. 15/02/2028	5 000	5 000	Alliant Holdings Intermediate LLC 6,750 % éch. 15/10/2027	5 000	4 602
TransDigm, Inc. 6,750 % éch. 15/08/2028	5 000	4 975	McAfee Corp. 7,375 % éch. 15/02/2030	5 000	4 275
NGL Energy Operating LLC 7,500 % éch. 01/02/2026	4 575	4 492	Occidental Petroleum Corp. 6,450 % éch. 15/09/2036	4 000	4 072
EQM Midstream Partners LP 4,500 % éch. 15/01/2029	4 700	4 234	Virgin Media Finance PLC 5,000 % éch. 15/07/2030	5 000	3 968
Transocean Titan Financing Ltd. 8,375 % éch. 01/02/2028	4 000	4 000	Occidental Petroleum Corp. 5,500 % éch. 01/12/2025	4 000	3 955
Radiate Holdco LLC 4,500 % éch. 15/09/2026	5 000	3 900	Park River Holdings, Inc. 6,750 % éch. 01/08/2029	5 000	3 863
MajorDrive Holdings LLC 6,375 % éch. 01/06/2029	4 800	3 808	BCPE Ulysses Intermediate, Inc. 7,750 % éch. 01/04/2027	5 000	3 856

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 2023		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	869 780	\$ 8 661	Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042	\$ 6 200	\$ 6 249
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		Obligations du Trésor américain 2,500 % éch. 15/02/2045	7 300	5 736
Billets du Trésor américain 3,375 % éch. 15/05/2033	\$ 7 700	7 473	Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 15/11/2032	5 300	5 559
Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 15/11/2032	5 300	5 542	Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2052	5 100	5 230
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2052	5 100	5 509	ACTIONS		
Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/02/2033	4 400	4 452	PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	381 593	3 800
Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/02/2043	4 400	4 416		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Obligations du Trésor américain 3,625 % éch. 15/02/2053	3 800	3 722	Obligations du Trésor américain 3,625 % éch. 15/02/2053	\$ 3 800	3 634
Morgan Stanley 5,250 % éch. 21/04/2034	3 600	3 600	Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032	2 900	2 760
Synchrony Financial 7,250 % éch. 02/02/2033	3 600	3 587	Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042	2 764	2 518
Bank of America Corp. 5,288 % éch. 25/04/2034	3 500	3 500	Obligations du Trésor américain 3,375 % éch. 15/08/2042	2 800	2 490
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,500 % éch. 15/02/2053 (b)	3 452	3 365	Novonia SE 0,000 % éch. 01/12/2025	€ 2 300	2 175
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042	3 200	3 348	Obligations du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2052	\$ 2 600	2 154
Amgen, Inc. 5,600 % éch. 02/03/2043	3 075	3 066	Synchrony Financial 7,250 % éch. 02/02/2033	2 400	2 127
Duke Energy Ohio, Inc. 5,650 % éch. 01/04/2053	2 400	2 437	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % éch. 16/11/2025	2 006	1 954
Apple, Inc. 4,850 % éch. 10/05/2053	2 100	2 089	DaVita, Inc. 4,625 % éch. 01/06/2030	2 200	1 829
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % éch. 15/01/2030	2 000	2 000	Elanco Animal Health, Inc. 1,000 % éch. 01/08/2027	1 543	1 520
Philip Morris International, Inc. 5,125 % éch. 15/02/2030	2 000	1 984	Wynn Resorts Finance LLC 7,125 % éch. 15/02/2031	1 500	1 493
Elevance Health, Inc. 4,750 % éch. 15/02/2033	1 800	1 797	Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/05/2043	1 300	1 268
Wynn Resorts Finance LLC 7,125 % éch. 15/02/2031	1 500	1 500	DAE Funding LLC 1,625 % éch. 15/02/2024	1 250	1 198
CVS Health Corp. 5,125 % éch. 21/02/2030	1 500	1 490	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,500 % éch. 15/08/2028	1 188	1 002
UBS Group AG 5,959 % éch. 12/01/2034	1 400	1 400	JPMorgan Chase & Co. 4,851 % éch. 25/07/2028	1 000	1 001
Southern California Gas Co. 5,200 % éch. 01/06/2033	1 300	1 297	Citizens Bank N.A. 4,575 % éch. 09/08/2028	1 000	977
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5,340 % éch. 19/05/2063	1 300	1 275	Aroundtown S.A. 5,375 % éch. 21/03/2029	1 200	947
Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/05/2043	1 300	1 257	Lloyds Banking Group PLC 4,716 % éch. 11/08/2026	900	888
			Freedom Mortgage Corp. 8,125 % éch. 15/11/2024	900	868
			Lloyds Banking Group PLC 4,976 % éch. 11/08/2033	900	859
			Obligations du Trésor américain 3,875 % éch. 15/02/2043	800	783
			UDR, Inc. 3,000 % éch. 15/08/2031	900	771
			Lloyds Banking Group PLC 4,375 % éch. 22/03/2028	800	759
			Barclays PLC 8,000 % éch. 15/03/2029	800	707

(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 du produit. 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.

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)	DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 30 JUIN 2023			VENTES JUSQU'AU 30 JUIN 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
Federal Home Loan Bank 5,500 % éch. 08/05/2025	38 000	38 000	Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025	63 700	62 354
Freddie Mac 5,950 % éch. 21/03/2025	33 000	33 000	Federal Home Loan Bank 1,115 % éch. 26/02/2027	31 500	27 837
Freddie Mac 5,550 % éch. 09/05/2025	25 000	25 000	Federal Home Loan Bank 0,900 % éch. 26/02/2027	26 500	22 994
Federal Home Loan Bank 5,480 % éch. 26/02/2025	22 400	22 400	Ginnie Mae 3,000 % éch. 20/07/2051	25 968	22 345
Freddie Mac 5,520 % éch. 28/05/2025	22 400	22 400	Ginnie Mae 3,000 % éch. 20/06/2051	22 856	19 763
Freddie Mac 5,820 % éch. 20/03/2025	21 000	21 000	ACTIONS		
Freddie Mac 5,680 % éch. 03/04/2025	21 000	21 000	PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	198 700	19 741
Freddie Mac 5,730 % éch. 03/04/2025	21 000	21 000		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Federal Home Loan Bank 5,650 % éch. 28/05/2025	21 000	21 000	Banque internationale pour la reconstruction et le développement		
Morgan Stanley 0,790 % éch. 30/05/2025	21 500	20 390	0,850 % éch. 10/02/2027	\$ 18 800	16 711
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. 6,395 % éch. 19/10/2031	20 250	20 136	Bayer U.S. Finance LLC 3,875 % éch. 15/12/2023	15 979	15 819
Federal Home Loan Bank 5,710 % éch. 14/03/2025	20 000	20 000	Danske Bank A/S 5,375 % éch. 12/01/2024	14 850	14 765
Freddie Mac 5,800 % éch. 03/07/2025	20 000	20 000	Wells Fargo & Co. 6,372 % éch. 25/04/2026	14 500	14 617
Athene Global Funding 5,790 % éch. 24/05/2024	14 200	14 073	BAT Capital Corp. 3,222 % éch. 15/08/2024	14 750	14 315
HCA, Inc. 5,000 % éch. 15/03/2024	14 000	13 906	AerCap Ireland Capital DAC 1,150 % éch. 29/10/2023	12 950	12 734
CIFC Funding Ltd. 6,323 % éch. 24/04/2030	13 891	13 791	Santander UK Group Holdings PLC 1,089 % éch. 15/03/2025	12 800	12 249
Westpac Banking Corp. 4,862 % éch. 16/11/2023	AUD 20 000	13 782	Eni SpA 4,000 % éch. 12/09/2023	11 800	11 743
Goldman Sachs Group, Inc. 1,757 % éch. 24/01/2025	\$ 13 100	12 714	Ginnie Mae 2,500 % éch. 20/06/2051	13 399	11 253
Barclays PLC 3,932 % éch. 07/05/2025	12 800	12 522	AerCap Ireland Capital DAC 4,500 % éch. 15/09/2023	10 000	9 940
Bank of America Corp. 0,976 % éch. 22/04/2025	12 500	11 926	Crédit Agricole S.A. 6,570 % éch. 22/03/2024	9 400	9 439
Boeing Co. 1,433 % éch. 04/02/2024	10 900	10 557	Bank of America Corp. 5,791 % éch. 24/10/2024	7 500	7 502
Freddie Mac 5,375 % éch. 24/04/2025	10 000	10 000	BPCE S.A. 4,000 % éch. 15/04/2024	7 500	7 385
Warnermedia Holdings, Inc. 3,428 % éch. 15/03/2024	10 125	9 921	BNP Paribas S.A. 3,800 % éch. 10/01/2024	7 280	7 195
JPMorgan Chase & Co. 4,023 % éch. 05/12/2024	10 000	9 877	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % éch. 18/09/2023	7 200	7 106
AerCap Ireland Capital DAC 1,150 % éch. 29/10/2023	10 000	9 752	Goldman Sachs Group, Inc. 0,925 % éch. 21/10/2024	6 700	6 546
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 6,439 % éch. 13/01/2026	9 700	9 700	Nordea Bank Abp 6,403 % éch. 30/08/2023	6 000	6 007
Morgan Stanley 3,737 % éch. 24/04/2024	9 350	9 323	7-Eleven, Inc. 0,800 % éch. 10/02/2024	6 000	5 779
CNH Industrial Capital LLC 4,200 % éch. 15/01/2024	9 000	8 924			
Bayer U.S. Finance LLC 3,875 % éch. 15/12/2023	8 479	8 391			

(a) Le Fonds US Short-Term 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 du produit. 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.

Glossaire : (abréviations susceptibles d'être utilisées dans les états qui précèdent)

Abréviations des contreparties :

AZD	Australia and New Zealand Banking Group	DUB	Deutsche Bank AG	MSC	Morgan Stanley & Co. LLC.
BOA	Bank of America N.A.	FAR	Wells Fargo Bank National Association	MYC	Morgan Stanley Capital Services LLC
BOM	Bank of Montreal	FBF	Credit Suisse International	MYI	Morgan Stanley & Co. International PLC
BOS	BofA Securities, Inc.	FCT	Credit Suisse Capital LLC	NOM	Nomura Securities International, Inc.
BPG	BNP Paribas Securities Corp.	FICC	Fixed Income Clearing Corporation	NXN	Natixis New York
BPS	BNP Paribas S.A.	GLM	Goldman Sachs Bank USA	PER	Pershing LLC
BRC	Barclays Bank PLC	GRE	NatWest Markets Securities, Inc.	RBC	Royal Bank of Canada
				RCY	Royal Bank of Canada
BSH	Banco Santander S.A. - Succursale de New York	GSC	Goldman Sachs & Co. LLC	RDR	RBC Capital Markets LLC
BSN	The Bank of Nova Scotia - Toronto	GST	Goldman Sachs International	RVM	Barclays Capital, Inc.
BSS	Banco Santander S.A.	HUS	HSBC Bank USA N.A.	RYL	NatWest Markets Plc
BYL	Barclays Bank PLC, succursale de Londres	IND	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	SAL	Citigroup Global Markets, Inc.
BYR	The Bank of Nova Scotia - Toronto				
CBK	Citibank N.A.	JLN	JP Morgan Chase Bank N.A. Londres	SCX	Standard Chartered Bank, Londres
CDI	Natixis Singapore	JML	JP Morgan Securities Plc	SOG	Société Générale Paris
CIB	Canadian Imperial Bank of Commerce	JPM	JP Morgan Chase Bank N.A.	SSB	Slate Street Bank and Trust Co.
CKL	Citibank N.A. Londres	JPS	J.P. Morgan Securities LLC	TDM	TD Securities (USA) LLC
CLY	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	MAC	Macquarie Bank Limited	TOR	The Toronto-Dominion Bank
		MBC	HSBC Bank Plc		
COM	Commerz Bank AG	MEI	Merrill Lynch International	UAG	UBS AG Stamford
CSN	Credit Suisse AG (New York)	MFK	Barclays Capital, Inc.	UBS	UBS Securities LLC
DBL	Deutsche Bank AG London				
DEU	Deutsche Bank Securities, Inc.				

Abréviations des devises :

AED	Dirham des EAU	GHS	Cedi ghanéen	PHP	Peso philippin
ARS	Peso argentin	HKD	Dollar de Hong Kong	PLN	Zloty polonais
AUD	Dollar australien	HUF	Forint hongrois	RON	Nouveau leu roumain
BRL	Réal brésilien	IDR	Roupie indonésienne	RSD	Dinar serbe
CAD	Dollar canadien	ILS	Shekel israélien	RUB	Rouble russe
CHF	Franc suisse	INR	Roupie indienne	SEK	Couronne suédoise
CLP	Peso chilien	JPY (ou ¥)	Yen japonais	SGD	Dollar de Singapour
CNH	Renminbi chinois (Offshore)	KES	Shilling kényan	THB	Baht thaïlandais
CNY	Renminbi chinois (Chine continentale)	KRW	Won sud-coréen	TRY	Nouvelle livre turque
COP	Peso colombien	KZT	Tenge kazakh	TWD	Dollar de Taiwan
CZK	Couronne tchèque	MXN	Peso mexicain	UGX	Shilling ougandais
DKK	Couronne danoise	MYR	Ringgit malaisien	USD (ou \$)	Dollar américain
DOP	Peso dominicain	NGN	Naira nigérian	UYU	Peso uruguayen
EGP	Livre égyptienne	NOK	Couronne norvégienne	VND	Dong vietnamien
EUR (ou €)	Euro	NZD	Dollar néo-zélandais	ZAR	Rand sud-africain
GBP (ou £)	Livre sterling	PEN	Nouveau Sol péruvien	ZMW	Kwacha zambien

Abréviations des marchés de change :

BIST	Borsa Istanbul Exchange	CME	Chicago Mercantile Exchange	Hors cote (OTC)	Hors cote
CBOT	Chicago Board of Trade	FTSE	Financial Times Stock Exchange		

Abréviations des indices/spread :

ABX.HE	Indice Asset-Backed Securities Index – Home Equity	CPTFEMU	Indice Eurozone HICP ex-Tobacco Index	NDUEACWF	Indice MSCI ACWI Index Future
ACS	Indice Algonquin Cityfats Natural Gas Basis Futures Index	CPURNSA	Indice Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index	NDUEEGF	iShares MSCI Emerging Markets ETF
AMZX	Indice Alerian MLP Total Return Index	DAX	Indice Deutscher Aktien Index 30	OMXS30	Indice Stockholm 30 Index
BCOMF1TC	Indice Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return	DWRTFT	Indice Dow Jones Wilshire REIT Total Return Index	PIMCOBDBU	PIMCO Custom Commodity Basket
BCOMTR	Indice Bloomberg Commodity Index Total Return	FRCPXTOB	Indice France Consumer Price ex-Tobacco Index	PrimeX.ARM	Indice Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage
BCOMTR1	Indice Bloomberg Custom Commodity Index	FTSE/JSE	Indice South African Performance Index	S&P 500	Indice Standard & Poor's 500 Index
BOVESPA	Indice Brazil Bovespa Index	FTSE/MIB	Indice Borsa Italiana's 40 Most Liquid/Capitalised Italian Shares Equity Index	S&P CNX Nifty	Indice Standard & Poor's Nifty 50 Index
CAC	Cotation Assistée en Continu	IBEX 35	Indice Spanish Continuous Exchange Index	SIBCSORA	Taux moyen au jour le jour de Singapour
CAONREPO	Taux moyen des mises en pension au jour le jour canadien	IBR	Indicador Bancario de Referencia	SONIO	Taux moyen interbancaire au jour le jour en livre sterling
CDX.EM	Indice Credit Derivatives Index - Emerging Markets	IXITR	Indice S&P's Industrials Select Sector Index	SPI 200	Indice Australian Equity Futures Index
CDX.HY	Indice Credit Derivatives Index - High Yield	JMABDEWU	Indice J.P. Morgan Custom Commodity Index	SRFXON3	Taux moyen au jour le jour de Suisse (18 h)
CDX.IG	Indice Credit Derivatives Index - Investment Grade	JMABNIU5	Indice J.P. Morgan Custom Commodity Index	TOPIX	Indice Tokyo Price Index
CIBBSTR3	Indice Custom Commodity Index	KOSPI	Indice Korea Composite Stock Price Index	TRNGLU	Indice FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD
CMBX	Indice Commercial Mortgage-Backed Index	KOSPI2	Indice Korea Stock Exchange KOSPI 200 Index	IPC Royaume-Uni (UKRPI)	Indice United Kingdom Retail Prices Index
CNREPOFIX	Taux des mises en pension de Chine à 7 jours	MUTKCALM	Taux moyen au jour le jour de Tokyo	VSTOXX	Indice Euro Stoxx 50 Volatility Index
CPALEMU	Indice Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index	NASDAQ	National Association of Securities Dealers Automated Quotations	WIG20	Indice boursier pondéré par la capitalisation des 20 plus grandes entreprises de la Bourse de Varsovie

Abréviations des obligations municipales ou des Agences :

AGM	Assured Guaranty Municipal	ST	État
------------	----------------------------	-----------	------

Autres abréviations :

ABS	Titre adossé à des actifs	EURIBOR	Taux interbancaire offert en euro	PRIBOR	Taux interbancaire offert à Prague
ALT	Alternate Loan Trust	HIBOR	Taux interbancaire offert à Hong Kong	REIT	Société d'investissement immobilier
BABs	Obligations Build America Bonds	JIBAR	Taux interbancaire convenu à Johannesburg	REMIC	Real Estate Mortgage Investment Conduit
BBR	Taux sur bons bancaires	JSC	Joint Stock Company (société par actions)	RMBS	Titre adossé à des créances hypothécaires résidentielles
BBSW	Taux de référence des swaps sur bons bancaires	KLIBOR	Taux interbancaire offert à Kuala Lumpur	STIBOR	Taux interbancaire offert à Stockholm
BRL-CDI	Taux de dépôt interbancaire brésilien	KORIBOR	Taux interbancaire offert en Corée	TAIBOR	Taux interbancaire offert à Taipei
BTP	Buoni del Tesoro Poliennali « obligation du Trésor à long terme »	LIBOR	Taux interbancaire offert à Londres	TBA	À annoncer
CBO	Obligation garantie (Collateralised Bond Obligation)	MIBOR	Taux interbancaire offert à Mumbai	À définir (TBD)	À définir
CDO	Obligation garantie (Collateralised Debt Obligation)	MSCI	Morgan Stanley Capital International	TBD%	Le taux d'intérêt est fixé lors du règlement du prêt ou au moment du financement
CHILIBOR	Taux interbancaire offert au Chili	NIBOR	Taux interbancaire offert en Norvège	TELBOR	Taux interbancaire offert à Tel-Aviv
CLO	Prêt garanti (Collateralised Loan Obligation)				
CMBS	Titre adossé à des créances hypothécaires garanti	OAT	Obligations Assimilables du Trésor	THB-THORON	Taux de rachat au jour le jour thaïlandais
DAC	Designated Activity Company (société à activité désignée)	OIS	Overnight Index Swap (Swap sur indice au jour le jour)	TIIE	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio « Equilibrium Interbank Interest Rate » (Taux d'intérêt d'équilibre interbancaire)
EUR-ESTRON	Taux à court terme en euro	PIK	Rémunération en nature	WIBOR	Taux interbancaire offert à Varsovie

Informations générales

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, Californie 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.

SERVICE DE PAIEMENT POUR L'AUTRICHE

UniCredit Bank Austria AG,
Schottengasse 6-8,
1010 Vienne,
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,
Mantoue,
Italie.

RBC Investor Services Bank S.A., succursale
milanaise,
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.

SERVICE DE PAIEMENT ET DE REPRÉSENTATION AU LUXEMBOURG

Société Générale Luxembourg,
(Centre opérationnel/FED),
28-32, Place de la Gare,
L-1616, Luxembourg.

SERVICE DE PAIEMENT ET DE REPRÉSENTATION 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.

SERVICE DE PAIEMENT EN BELGIQUE

ABN AMRO BANK S.A.,
Borsbeeksebrug 30,
2600 Anvers,
Belgique.

SERVICE DE PAIEMENT ET D'INFORMATION EN ALLEMAGNE

Marcard, Stein & Co AG,
Ballindamm 36,
20095 Hambourg,
Allemagne.

SERVICE DE PAIEMENT AU PORTUGAL

Banco Activobank (Portugal) S.A.,
Rua Augusta 86,
1149-023, Lisbonne,
Portugal.

SERVICE DE PAIEMENT EN SUÈDE

SEB Merchant Banking,
SE-106 40,
Stockholm,
Suède.

SERVICE DE PAIEMENT EN GRÈCE

Eurobank Asset Management M.F.M.C.,
10 Stadiou Street,
GR 10564 Athènes,
Grèce.

SERVICE DE PAIEMENT EN HONGRIE

European Investment Centre,
Tomasikova 64,
831 04 Bratislava,
République slovaque.

SERVICE DE PAIEMENT EN RÉPUBLIQUE TCHÈQUE

European Investment Centre,
Veveří 2581/102,
616 00 Brno,
République tchèque.

AGENT CENTRALISATEUR ET FINANCIER FRANÇAIS

Société Générale,
29, Boulevard Haussmann,
75009 Paris,
France.

SERVICE DE PAIEMENT AU LIECHTENSTEIN

LGT Bank Ltd.,
Herrengasse 12,
FL-9490 Vaduz,
Liechtenstein.

SERVICE DE PAIEMENT 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 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

(jusqu'au 25 janvier 2023)
State Street Fund Services (Ireland)
Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irlande.

(à compter du 26 janvier 2023)
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 DU GESTIONNAIRE

V. Mangala Ananthanarayanan¹ (Inde)
Ryan P. Blute¹ (États-Unis)
John Bruton (Administrateur
indépendant) (Irlande)
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 pour l'investisseur et les rapports annuels et semestriels sont disponibles gratuitement auprès du représentant ou de l'agent de chaque juridiction. Les actionnaires peuvent obtenir gracieusement une copie des changements apportés au portefeuille au cours de la période close le 30 juin 2023 auprès du Dépositaire ou des Services de paiement, du Service de paiement 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 particuliers, 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 en Espagne (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 des règlements 2017 de l'Union européenne (Marchés d'instruments financiers), tels que modifiés ; (3) Succursale britannique : la Financial Conduct Authority ; et (4) 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 dans les 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 sur le commerce des valeurs mobilières (WpHG). Ils ne sont pas accessibles aux investisseurs particuliers, qui ne doivent pas se fier à la présente communication.

PIMCO (Schweiz) GmbH (société immatriculée en Suisse sous le n° CH-020.4.038.582-2). Les services fournis par PIMCO (Schweiz) GmbH ne sont pas accessibles aux investisseurs particuliers, qui ne doivent pas se fier à la présente communication, mais contacter leur conseiller financier.